

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/12/8(月) <セントラル短資株式会社>

<<資金需給>>

単位 億円

	8日需給速報	9日需給予想	10日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	0	▲ 1,300	▲ 2,000
財政	▲ 16,400	5,700	▲ 7,000
資金過不足	▲ 16,400	4,400	▲ 9,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)	1,400	5,700	
80,277	▲ 1,700	▲ 6,100	
国債買現			
0			
CP買現			
0			
国庫短期証買入		7,500	
国庫短期証売却			
国債買入		8,600	
CP等買入		4,500	
	▲ 300	▲ 500	
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 159,053			
被災地支援			
3,246			
社債等買入	▲ 200	▲ 200	
ETF買入		200	
国債補充供給	100		
小計	▲ 700	19,700	0
当預増減	▲ 17,100	24,100	▲ 9,000

当座預金残高	1,663,900	12/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,521,400		7,400
積み終了先	1,285,400	12/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,285,400	積数	6,200
非準預先残高	142,500	1日平均	900
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)			1,887,600
準備預金進捗率	99.67% (実績)	76.67% (日数)	

12/5のマネタリーベース	2,610,700
12/5コール合計	202,200無担 81,923有担 120,277
コール前日増減	計 ▲ 2,145無担 ▲ 1,142有担 ▲ 1,003

12/8 の加重平均レート(速報)				12/5 の加重平均レート(確報)				単位 (%)
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分		
0.055 ~0.075 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.030 ~0.080 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)		
0.063 ~0.120 (0.068)				T/N		0.066 ~0.120 (0.081)		
				S/N				
0.200 ~0.260 (0.217)				1W		0.116 ~0.125 (0.121)		
0.115 (0.115)				2W		0.160 ~0.310 (0.179)		
0.115 (0.115)				3W		0.118 (0.118)		
		0.08-0.12	-	1M		0.078 ~0.118 (0.082)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	-	3M				
		-	▲0.002-▲0.005	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 67億円 12/8 ~ 12/9 (1日間) 応札 2億円 落札 2億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
T-Bill6M 応札33兆7,411億円 落札3兆2,457億円(非競争入札:2,542億円) 12/10~2015/6/10 0.0000% 按分 6.9769% 平均 ▲0.0020%
ETF買入 374億円 約定日 12/8
J-REIT買入 13億円 約定日 12/8

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。」

金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。
金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。
セントラル短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入

<< 12/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,688,000	前日比	24,100
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12
無担O/Nは0.06~0.065%の出合いが中心になると見込まれる。					

<< 8日のインターバンク市場動向 >>
午前8時発表の準備預金残高見込みは、前営業日比1兆1,000億円減の12兆8,000億円(当座預金残高見込みは16兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.063~0.065%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。週末要因が剥落した事で、一巡後は0.06%前後で散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

<< 8日のオープン市場動向 >>
現先取引S/Nは横ばい圏で推移。短国市場では6M物入札が実施された。落札結果は、平均落札利回▲0.002%、按分落札利回±0%と事前予想の通りの結果となった。6M物としては初めてマイナス水準での決着となった。セカンダリーは平均落札利回り近辺での出合いが見られた。CP市場は、償還総額2,200億円程度に対し、5・10日発行にあたったため、発行総額は3,700億円程度に膨らんだ。発行レートは、年内償還物に上昇傾向がみられた一方、年越物はディーラー・投資家の運用ニーズが強いいため、横ばいないしは小幅低下しての決着が中心であった。

<< 9日の材料 >>
*11月のマネースtock
*米国10月の卸売売上高
*30年利付国債入札(7,000億円、12/22発行)
*交付税特別会計借入(10,500億円、12/17借入)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	121.60-63
0.435	0.015	為替(5時)	121.34-36

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	12/1	12/2	12/3	12/4	12/5	12/8
日銀当預残	1,692,900	1,685,200	1,658,300	1,659,800	1,681,000	1,663,900
準備預金残	1,549,700	1,546,500	1,518,000	1,514,700	1,537,200	1,521,400
レート	0.065%	0.065%	0.065%	0.065%	0.067%	0.065%
月中平均	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06586%	0.06575%