

2014/12/9(火)

<<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,400	▲ 1,400	▲ 3,000
財政		4,500	▲ 10,500	0
資金過不足		3,100	▲ 11,900	▲ 3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		5,700		
79,847		▲ 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		
		▲ 500	▲ 1,500	
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		
ETF買入		200	500	
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		19,600	▲ 900	0
当預増減		22,700	▲ 12,800	▲ 3,000

当座預金残高	1,686,600	12/9以降の残り所要積立額	6,200
準備預金残高	1,537,300	12/10以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,303,400	積数	5,400
超過準備	1,303,400	1日平均	900
非準備先残高	149,300	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	99.71% (実績)		80.00% (日数)

12/8のマネタリーベース		2,593,600	
12/8コール	合計 198,973	無担 77,804	有担 121,169
コール前日増減	計 ▲ 3,227	無担 ▲ 4,119	有担 892

12/9 の加重平均レート(速報)			12/8 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
0.050 ~0.125 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.075 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.062 ~0.125 (0.079)				T/N	0.063 ~0.120 (0.068)	
				S/N		
0.075 ~0.180 (0.110)				1W	0.200 ~0.260 (0.217)	
0.115 ~0.240 (0.171)				2W	0.115 (0.115)	
				3W	0.115 (0.115)	
0.220 ~0.230 (0.224)		0.08-0.12	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.007	3M		
		-	▲0.005	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 2,000億円 12/9 ~ 12/10 (1日間) 応札 64億円 落札 64億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 12/11~12/18 (7日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.610%

30年利付国債(表面利率1.5%) 応札2兆58億円 落札6,431億円(I非競争入札:562億円) 12/22~2044/12/20 1.464% 按分72.4839% 平均1.456%

交付税特会 1兆500億円 12/17~2015/6/18 応札 2兆6,405億円 落札 1兆500億円 0.090% 按分 72.1650% 平均 0.090%

ETF買入 374億円 約定日 12/9

<< 12/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,673,800	前日比	▲ 12,800
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。

<< 9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、前日比2兆2,000億円増の131兆円(当座預金残高見込みは168兆8,000億円)。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。一巡後は0.06%台前半で散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。タム物は、目立った出合いは見られなかった。

<< 9日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばいで推移した。短国アウトライト市場は、売り物が少なく全般的に閑散な状態が続いており、3M▲0.007% 6M▲0.005%で散発的な出合いが見られた程度であった。CP市場はノンバンク業態からまとまった発行案件が見られたものの、全体の件数は少なく発行総額は500億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏であった。

<< 10日の材料 >>
 *10-12月期の法人企業景気予測調査季報
 *10月の特定サービス産業動向統計速報
 *11月の企業物価指数 *11月の消費動向調査
 *米国11月の財政収支
 *国庫短期証券入札(2ヶ月、25,000億円、12/15発行)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.64-65
0.415 ▲0.020	17,813.38 ▲122.26	為替(5時)	119.66-67

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	12/2	12/3	12/4	12/5	12/8	12/9
日銀当預残	1,685,200	1,658,300	1,659,800	1,681,000	1,663,900	1,686,600
準備預金残	1,546,500	1,518,000	1,514,700	1,537,200	1,522,500	1,537,300
レート	0.065%	0.065%	0.065%	0.067%	0.065%	0.073%
月中平均	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06586%	0.06575%	0.06656%

「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