

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想		12日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		-1,500	-3,100	-3,000		
財政		-10,900	2,700	-1,000		
資金過不足		-12,400	-400	-4,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					3,800	
79,847					-2,600	
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						
国庫短期証売却						
国債買入					13,000	
CP等買入						
		-1,500	-300			
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						
ETF買入		500	200			
国債補完供給		100				
小計		-900	-100	14,200		
当預増減		-13,300	-500	10,200		

当座預金残高	1,673,300	12/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,528,000		5,400
積み終了先	1,291,700	12/11以降の残り所要積立額	
超過準備	1,291,400	積数	4,000
非準預先残高	145,300	1日平均	800
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	99.79% (実績)	83.33% (日数)	

12/9のマネタリーベース		2,617,800	
12/9コール	合計 199,749	無担 81,139	有担 118,610
コール前日増減	計 776	無担 3,335	有担 -2,559

12/10の加重平均レート(速報)				12/9の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分	
0.050	~0.125 (0.067)	0.030	~0.040 (0.031)	0.050	~0.125 (0.073)			0.030	~0.040 (0.031)
0.064	~0.130 (0.087)					0.062	~0.125 (0.079)		
0.075	(0.075)			1W	0.145 (0.145)	0.075	~0.180 (0.108)		
0.116	(0.116)			2W		0.115	~0.240 (0.171)		
				3W					
0.075	(0.075)			1M		0.220	~0.230 (0.224)		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12	▲0.0064-0.000	3M					
			▲0.006	6M					
			▲0.005	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	10,000億円	12/12 ~ 3/24 (102日間)	応札 3,810億円	落札 3,810億円	0.100%	全取	平均 0.100%	(固定)
国債補完	2,000億円	12/10 ~ 12/11 (1日間)	応札 27億円	落札 27億円	-0.400%	全取	平均 -0.400%	(即)
国債買入	4,500億円	12/12	応札 12,748億円	落札 4,509億円	按分利回り較差 0.007%	62.5%	平均利回り較差 0.007%	
国債買入	4,500億円	12/12	応札 12,639億円	落札 4,504億円	按分利回り較差 0.003%	2.1%	平均利回り較差 0.004%	
国債買入	2,400億円	12/12	応札 5,976億円	落札 2,406億円	按分利回り較差 -0.013%	29.7%	平均利回り較差 -0.009%	
国債買入	1,600億円	12/12	応札 3,977億円	落札 1,602億円	按分利回り較差 -0.039%	77.1%	平均利回り較差 -0.029%	
T-Bill2M	応札2兆2,389億円	落札2兆3,208億6,000万円(非競争入札:1,791億円)	12/15~2015/2/4	▲0.0035%	按分26.2879%	平均▲0.0064%		
J-REIT買入	13億円	約定日 12/10						

<< 12/11の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,672,800	前日比	-500
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。

<< 10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1兆8,000億円減の129兆2,000億円(当座預金残高見込みは167兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託・証券業態から0.064~0.065%での調達で始まった。昨日までと比べ、調達ニーズはやや強く、出合い一巡後もビッド水準は0.063%近辺で底堅く推移し本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件が数件見られた。

<< 10日のオープン市場動向 >>

現先S/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は、2M物(499回)入札が実施された。落札結果は平均落札利回り▲0.0064% 按分落札利回り▲0.0035% 按分率26.2879%と引続き堅調な結果となった。セカンダリーは▲0.005~0.000%の出合い。CP市場は、償還総額1,600億円程度に対し、発行総額は950億円程度にとどまった。発行レートは、概ね横ばい圏となっていた。

<< 11日の材料 >>

- *10月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲2.4%)
- *10月のマネタリーサーベイ *10月の第3次産業活動指数
- *米国10月の企業在庫 *米国11月の小売売上高
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、12/15発行)
- *流動性供給入札(4,000億円、12/15発行)

JGB新発10年債	0.410	-0.005	日経平均株価(終値)	17,412.58	-400.80	為替(9時)	119.34-37
						為替(5時)	119.08-10

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	12/3	12/4	12/5	12/8	12/9	12/10
日銀当預残	1,658,300	1,659,800	1,681,000	1,663,900	1,686,600	1,673,300
準備預金残	1,518,000	1,514,700	1,537,200	1,522,500	1,539,400	1,528,000
レート	0.065%	0.065%	0.067%	0.065%	0.073%	0.067%
月中平均	0.06500%	0.06500%	0.06586%	0.06575%	0.06656%	0.06660%

「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