

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/12/22(月) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

| | 22日需給速報 | | 24日需給予想 | | 25日当社予想 | |
|---------------------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|----|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | ▲ 4,000 | ▲ 4,000 | ▲ 4,000 | | |
| 財政 | | 30,700 | ▲ 800 | 4,000 | | |
| 資金過不足 | | 26,700 | ▲ 4,800 | 0 | | |
| 貸出 | | 100 | ▲ 100 | | | |
| 売出手形 | | | | | | |
| 0 | | | | | | |
| 本店共通 | | | | | | |
| 0 | | | | | | |
| 全店共通 | | | | | | |
| 0 | | | | | | |
| 共通(固定) | | 1,000 | | | | |
| 79,571 | | ▲ 2,500 | | | | |
| 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 | | 18,800 | | 13,000 | | |
| CP等買入 | | ▲ 1,000 | ▲ 500 | | | |
| 貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789 | | | | | | |
| 被災地支援 | | 3,246 | | | | |
| 社債等買入 | | | | | | |
| ETF買入 | | 200 | | | | |
| 国債補完供給 | | | | | | |
| 小計 | | 16,600 | ▲ 600 | 13,000 | | |
| 当預増減 | | 43,300 | ▲ 5,400 | 13,000 | | |

| 当座預金残高 | 1,791,900 | 12/22以降の残り所要積立額 | 71,400 |
|---------|-------------|----------------------------|-------------|
| 準備預金残高 | 1,630,100 | 12/24以降の残り所要積立額 | |
| 積み終了先 | 1,305,700 | 積数 | 51,800 |
| 超過準備 | 1,302,500 | 1日平均 | 2,300 |
| 非準備先残高 | 161,800 | 積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数) | 1,964,200 |
| 準備預金進捗率 | 97.36% (実績) | | 25.81% (日数) |

| << 12/24の日銀調節とレート予想 >> | | | | | |
|------------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 1,786,500 | 前日比 | ▲ 5,400 |
| 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%近辺の出合いが中心になると見込まれる。

<< 22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、131兆8,000億円(当座預金残高見込みは179兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行から0.065%のビッドが提示されたことで、他業態のビッドが0.065~0.067%と押し上げられ、出合いの中心は0.067%となった。一巡後もさほど調達レートは低下せず、0.065~0.067%での出合いが見られつつ、前場の取引を終えた。後場に入ると、特段目立った出合いはなく、閑散な状態となった。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが散見される程度であった。

<< 22日のオープン市場動向 >>
 現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、短国買入オペが見送られる中、1Yで▲0.07%の出合いが若干見られた程度にとどまり、終始閑散であった。CP市場は5・10日発行にあたることから、電気、自動車、ノンバンク業態等からの大型発行案件が散見され、2,000億円強の償還に対して、4,500億程度と発行が膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移した。

<< 23日の材料 >>
 *米国7-9月期のGDP確報値 *米国11月の新築一戸建て販売件数
 *米国11月の耐久財新規受注 *米国11月の個人所得・消費支出
 *英国7-9月期のGDP確報値

<< 24日の材料 >>
 *特にありません

| JGB新発10年債 | 日経平均株価(終値) | 為替(9時) | 119.51-53 |
|------------------|--------------------|--------|-----------|
| 0.335 ▲ 0.020 | 17,635.14 13.74 | 為替(5時) | 119.59-60 |

| 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 | 12/15 | 12/16 | 12/17 | 12/18 | 12/19 | 12/22 |
| 日銀当預残 | 1,691,600 | 1,742,500 | 1,743,900 | 1,747,100 | 1,748,600 | 1,791,900 |
| 準備預金残 | 1,550,400 | 1,587,400 | 1,586,800 | 1,588,500 | 1,578,200 | 1,630,100 |
| レート | 0.069% | 0.067% | 0.068% | 0.066% | 0.065% | 0.066% |
| 月中平均 | 0.06827% | 0.06819% | 0.06818% | 0.06806% | 0.06762% | 0.06748% |

| 12/19のマネタリーベース | | | | 2,702,400 | | |
|----------------|----|---------|----|-----------|----|---------|
| 12/19コール | 合計 | 189,789 | 無担 | 67,201 | 有担 | 122,588 |
| コール前日増減 | 計 | 3,288 | 無担 | 3,376 | 有担 | ▲ 88 |

| 12/22の加重平均レート(速報) | | | | 12/19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 | O/N | 無担当日分 | 無担先日付分 | 有担当日分 | |
| 0.050 | ~0.075 (0.066) | 0.030 | ~0.040 (0.031) | | | 0.050 | ~0.135 (0.065) | | 0.030 | ~0.040 (0.031) |
| 0.065 | ~0.120 (0.074) | | | | | T/N | | 0.065 | ~0.120 (0.077) | |
| | | | | | | S/N | | | | |
| 0.068 | ~0.180 (0.124) | | | | | 1W | 0.117 (0.117) | 0.117 | ~0.270 (0.127) | |
| 0.235 | (0.235) | | | | | 2W | | 0.130 | (0.130) | |
| | | | | | | 3W | | 0.082 | (0.082) | |
| | | | | 0.08-0.12 | - | 1M | | 0.087 | ~0.119 (0.101) | 有担先日付分 |
| | | | | 0.08-0.12 | - | 2M | | | | |
| | | | | 0.08-0.12 | - | 3M | | 0.200 | (0.200) | |
| | | | | - | - | 6M | | | | |
| | | | | - | ▲ 0.07 | 1Y | | | | |

<<オペ情報、入札結果>>

| | | | | | | | | | | | |
|------|---------|-------|----|----------|----|---------|---------|---------|-------|---------|---------|
| 国債買入 | 4,500億円 | 12/25 | 応札 | 11,241億円 | 落札 | 4,503億円 | 按分利回り較差 | 0.011% | 67.1% | 平均利回り較差 | 0.012% |
| 国債買入 | 4,500億円 | 12/25 | 応札 | 12,364億円 | 落札 | 4,500億円 | 全取利回り較差 | 0.004% | | 平均利回り較差 | 0.005% |
| 国債買入 | 2,400億円 | 12/25 | 応札 | 6,687億円 | 落札 | 2,404億円 | 按分利回り較差 | -0.012% | 94.3% | 平均利回り較差 | -0.010% |
| 国債買入 | 1,600億円 | 12/25 | 応札 | 3,757億円 | 落札 | 1,601億円 | 按分利回り較差 | -0.028% | 49.2% | 平均利回り較差 | -0.019% |

「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録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