

# 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)		0.065 ~0.120 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.065 ~0.120 (0.074)									
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