

◀資金需給▶

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想	26日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 4,000	▲ 5,400	▲ 4,000
財政		▲ 2,500	4,500	3,000
資金過不足		▲ 6,500	▲ 900	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
79,571				
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			13,700	
CP等買入				
		▲ 500	▲ 1,000	
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789				
被災地支援				0
3,246				0
社債等買入			▲ 200	
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		▲ 600	12,600	0
当預増減		▲ 7,100	11,700	▲ 1,000
当座預金残高	1,784,800	12/24以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,623,600	51,800		
積み終了先	1,300,500	12/25以降の残り所要積立額		
超過準備	1,299,700	積数 46,500		
非準備先残高	161,200	1日平均 2,100		
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	97.63%	(実績)	29.03%	(日数)

12/22のマナリーベース		2,749,700	
12/22コール	合計	195,638	無担 69,833 有担 125,805
コール前日増減	計	5,849	無担 2,632 有担 3,217

12/24 の加重平均レート(速報)			12/22 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 ~0.135 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.075 (0.066)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.065 ~0.120 (0.096)					0.065 ~0.120 (0.074)	
					0.068 ~0.180 (0.124)	
					0.235 (0.235)	
0.115 (0.115)						
0.150 (0.150)		0.08-0.12	-			有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	0.0000			
		-	-			
		-	-			
		-	-			

◀ 12/25の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,796,500	前日比	11,700
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.065%近辺の出合いが中心になると見込まれる。

◀ 24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、130兆3,000億円(当座預金残高見込みは178兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、週初と同様に、大手行の0.065%のビッドが下支えとなって他業態のビッドが0.066~0.067%と押し上げられ、出合いの中心は0.067%となった。一巡後は若干調達レートが低下し、0.065%での出合いが数件見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、本日もロール案件の出合いが中心であった。本日の米ドル資金供給オペは、今年初めての年末越え物となったこともあって、15億2,800万ドルの応札がみられた。10億ドル以上の応札がみられたのは2012年1月31日のオペ以来。

◀ 24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、本日も短国買入オペが見送られる中、3M0.000%で少額の出合いが見られた程度で、極めて閑散な地合いであった。CP市場は、電気・ノンバンク業態等から発行が見られ、3,000億円台半ばの発行となった。償還は5,000億円強であった。発行レートは概ね横ばいであった。

◀ 25日の材料 ▶
 *黒田日銀総裁、日本経済団体連合会審議会にて講演
 *日銀金融政策決定会合議事要旨(11月18、19日開催分)
 *11月の企業向けサービス価格指数 *11月の住宅着工統計
 *米国・欧州・英国休日(Christmas Day)
 *2年利付国債入札(25,000億円、2015/1/15発行)

JGB新発10年債	0.325	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,854.23	219.09	為替(9時)	120.67-68
						為替(5時)	120.41-43

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	12/16	12/17	12/18	12/19	12/22	12/24
日銀当預残	1,742,500	1,743,900	1,747,100	1,748,600	1,791,900	1,784,800
準備預金残	1,587,400	1,586,800	1,588,500	1,578,200	1,631,100	1,623,600
レート	0.067%	0.068%	0.066%	0.065%	0.066%	0.067%
月中平均	0.06819%	0.06818%	0.06806%	0.06762%	0.06748%	0.06746%

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完 1,936億円 12/24 ~ 12/25 (1日間) 応札 102億円 落札 102億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 12/29~2015/1/8 (10日間) 応札 15億2,800万ドル 落札 15億2,800万ドル 貸付利率 0.630%

「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