

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/12/25(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

| | 25日需給速報 | | 26日需給予想 | 29日当社予想 |
|------------|---------|---------|---------|---------|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | ▲ 5,200 | ▲ 5,100 | ▲ 2,000 |
| 財政 | | 4,400 | 1,100 | ▲ 1,000 |
| 資金過不足 | | ▲ 800 | ▲ 4,000 | ▲ 3,000 |
| 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 | | ▲ 1,000 | ▲ 1,300 | |
| 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 | 100 | |
| 小計 | | 12,500 | ▲ 1,200 | 0 |
| 当預増減 | | 11,700 | ▲ 5,200 | ▲ 3,000 |

| | | | |
|----------------------------|-------------|-----------------|-------------|
| 当座預金残高 | 1,796,500 | 12/25以降の残り所要積立額 | |
| 準備預金残高 | 1,631,000 | | 46,500 |
| 積み終了先 | 1,306,500 | 12/26以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 1,306,500 | 積数 | 41,000 |
| 非準預先残高 | 165,500 | 1日平均 | 2,000 |
| 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 | 97.91% (実績) | | 32.26% (日数) |

| 12/24のマナタリーベース | | 2,746,600 | |
|----------------|----|-----------|----------------------|
| 12/24コール | 合計 | 194,912 | 無担 68,824 有担 126,088 |
| コール前日増減 | 計 | ▲ 726 | 無担 ▲ 1,009 有担 283 |

| << 12/26の日銀調節とレート予想 >> | | | | | |
|----------------------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 1,791,300 | 前日比 | ▲ 5,200 |
| O/N | 0.05~0.07 | T/N | 0.05~0.12 | S/N | 0.03~0.12 |
| 無担O/Nは0.06%台後半での出合いが中心になると見込まれる。 | | | | | |

<< 25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、131兆1,000億円(当座預金残高見込みは179兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託業態から0.067~0.068%、大手行からは0.065%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.068%となるなど、昨日よりもやや強めの立ち上がりとなった。一巡後は、0.065%近辺での出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1M物0.118%で調達を行った。

<< 25日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は高止まりで推移した。短国市場は、参加者が少ない中で3M 0.002%、1Y▲0.065%での調整売りが散見された。CP市場は償還総額2,300億円程度に対し、石油・電機業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は3,100億円程度まで膨らんだ。発行レートは一部の銘柄で小幅上昇する動きが見られた。CP等買入オペが実施され、平均落札利回0.089%・按分落札利回0.085%と前回から低下する結果となった。

<< 26日の材料 >>
 *11月の完全失業率(市場予想: 3.5%)
 *11月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比▲3.8%)
 *11月の有効求人倍率(市場予想: 1.10倍)
 *11月全国・12月都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想: 全 国(11月)前年同月比(除く生鮮): +2.7%
 : 東京都都区部(12月)前年同月比(除く生鮮): +2.3%
 *11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想: 前年比+0.8%)
 *11月の商業販売統計速報 *11月の毎月勤労統計調査速報
 *欧州休日(Christmas Holiday) *英国休日(Boxing Day)

| | | | | | | | |
|-----------|-------|---------|------------|-----------|---------|--------|-----------|
| JGB新発10年債 | 0.310 | ▲ 0.015 | 日経平均株価(終値) | 17,808.75 | ▲ 45.48 | 為替(9時) | 120.40-42 |
| | | | | | | 為替(5時) | 120.09-12 |

| 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 | 12/17 | 12/18 | 12/19 | 12/22 | 12/24 | 12/25 |
| 日銀当預残 | 1,743,900 | 1,747,100 | 1,748,600 | 1,791,900 | 1,784,800 | 1,796,500 |
| 準備預金残 | 1,586,800 | 1,588,500 | 1,578,200 | 1,631,100 | 1,624,500 | 1,631,000 |
| レート | 0.068% | 0.066% | 0.065% | 0.066% | 0.067% | 0.068% |
| 月中平均 | 0.06818% | 0.06806% | 0.06762% | 0.06748% | 0.06746% | 0.06748% |

| 12/25の加重平均レート(速報) | | | | 12/24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 | | |
| 0.040 ~0.125 (0.068) | 0.030 ~0.040 (0.031) | | | O/N 0.050 ~0.135 (0.067) | | 0.030 ~0.040 (0.031) | | |
| 0.078 ~0.120 (0.108) | | | | T/N | 0.065 ~0.120 (0.096) | | | |
| | | | | S/N | | | | |
| 0.055 (0.055) | | | | 1W | | | | |
| | | | | 2W | | | | |
| | | | | 3W | 0.115 (0.115) | | | |
| 0.118 (0.118) | | 0.08-0.12 | - | 1M | 0.150 (0.150) | 有担先日付分 | | |
| | | 0.08-0.12 | - | 2M | | | | |
| | | 0.08-0.12 | 0.0020 | 3M | | | | |
| | | - | - | 6M | | | | |
| | | - | ▲0.065 | 1Y | | | | |

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 1,420億円 12/25 ~ 12/26 (1日間) 応札 52億円 落札 52億円 -0.400% 全取 平均 -0.481% (即)
 CP買入 5,000億円 12/30 応札 10,720億円 落札 4,968億円 按分レート 0.085% 66.9% 平均落札レート 0.089%
 2年利付国債(表面利率0.1%)応札14兆1,819億円落札2兆5,066億円(I非競争入札:1,930億円)2015/1/15~2017/1/15 0.000%按分18.0142%平均▲0.003%
 J-REIT買入 13億円 約定日 12/25

「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