

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/12/26(金)

《セントラル短資株式会社》

## 《資金需給》

単位 億円

	26日需給速報		29日需給予想	30日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 5,500	▲ 4,200	▲ 900
財政		900	▲ 4,500	▲ 2,600
資金過不足		▲ 4,600	▲ 8,700	▲ 3,500
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				5,400
CP等買入				5,000
		▲ 1,300	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789				
被災地支援		0		
3,251		0		
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 100		
		100	100	
小計		▲ 1,300	▲ 300	10,400
当預増減		▲ 5,900	▲ 9,000	6,900

当座預金残高	1,790,600	12/26以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,626,100		41,000
積み終了先	1,305,100	12/29以降の残り所要積立額	
超過準備	1,304,900	積数	29,100
非準備先残高	164,500	1日平均	1,600
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	98.52%	(実績)	41.94% (日数)

12/25のマナタリーベース		2,763,600	
12/25コール	合計	194,011	無担 66,118 有担 127,893
コール前日増減	計	▲ 901	無担 ▲ 2,706 有担 1,805

12/26 の加重平均レート(速報)				12/25 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	~0.135 (0.068)	0.030	~0.040 (0.031)			O/N	0.040 ~0.125 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.068	~0.120 (0.090)					T/N		0.078 ~0.120 (0.108)	
0.050	(0.050)					S/N			
0.060	~0.118 (0.068)					1W	0.055	(0.055)	
						2W			
0.116	(0.116)					3W			
0.100	(0.100)			0.08-0.12	-	1M	0.118	(0.118)	有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M			
0.117	(0.117)			0.08-0.12	0.001-0.002	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

## 《オペ情報、入札結果》

国債補完	2,000億円	12/26	~ 12/29 (3日間)	応札	65億円	落札	65億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	4,000億円	12/30		応札	12,464億円	落札	4,013億円	按分利回り較差	-0.010%	7.8%	平均利回り較差	-0.008%
国債買入	1,400億円	12/30		応札	3,383億円	落札	1,400億円	按分利回り較差	0.280円	48.0%	平均利回り較差	0.123円

「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

《 12/29の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,781,600	前日比	▲ 9,000
O/N	0.05~0.07	T/N	0.03~0.12	S/N	0.05~0.12

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。

### 《 26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、130兆7,000億円(当座預金残高見込みは179兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託業態から0.067~0.069%、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週末の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1M0.118%で調達を行った。

### 《 26日のオープン市場動向 》

現先S/N物は横ばい圏で推移。短国市場は、3M物で0.001~0.002%で散発的な出合いが見られた程度であった。CP市場は償還総額18,500億円程度に対し、発行総額は6,200億円程度となった。月末発行ということもあって幅広い業態からの発行案件が見られたものの、四半期末に積み上がった償還額が大幅に上回り、償還超となった。発行レートは期越えの運用が一巡したこともあり、小幅に上昇した。

### 《 29日の材料 》

\*特にありません

JGB新発10年債	0.330	0.020	日経平均株価(終値)	17,818.96	10.21	為替(9時)	120.38-41
						為替(5時)	120.28-32

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	12/18	12/19	12/22	12/24	12/25	12/26
日銀当預残	1,747,100	1,748,600	1,791,900	1,784,800	1,796,500	1,790,600
準備預金残	1,588,500	1,578,200	1,631,100	1,624,500	1,631,000	1,626,100
レート	0.066%	0.065%	0.066%	0.067%	0.068%	0.068%
月中平均	0.06806%	0.06762%	0.06748%	0.06746%	0.06748%	0.06754%