

**<<資金需給>>**

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想	5日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 4,300	▲ 700	8,000
財政		▲ 4,200	▲ 5,200	▲ 4,000
資金過不足		▲ 8,500	▲ 5,900	4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,400
79,571				▲ 3,300
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			5,600	
CP等買入			5,000	
		▲ 400	▲ 5,600	
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789				
被災地支援				
3,251				
社債等買入				
ETF買入			700	
国債補完供給		100		
小計		▲ 300	5,700	▲ 900
当増減		▲ 8,800	▲ 200	3,100

当座預金残高	1,781,800	12/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,614,700		29,100
積み終了先	1,303,200	12/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,302,000	積数	25,500
非準備先残高	167,100	1日平均	1,500
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			1,963,700
準備預金進捗率	98.70%	(実績)	45.16% (日数)

12/26のマネタリーベース				2,763,200
12/26コール	合計	186,482	無担	65,844
			有担	120,638
コール前日増減	計	▲ 7,529	無担	▲ 274
			有担	▲ 7,255

12/29の加重平均レート(速報)				12/26の加重平均レート(確報)			
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 ~0.125 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.040 ~0.135 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.055 ~0.170 (0.109)					0.068 ~0.120 (0.090)		
					0.050 (0.050)		
0.118 ~0.260 (0.166)				0.060 (0.060)	0.118 (0.118)		
0.145 (0.145)							
					0.116 (0.116)		
0.118 ~0.145 (0.118)		0.08-0.12	-		0.100 ~0.118 (0.114)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-				
		0.08-0.12	0.0010		0.117 (0.117)		
		-	-				
		-	-				

<< 12/30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	▲ 200
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%近辺での出合いが中心になると見込まれる。

<< 29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、130兆4,000億円(当座預金残高見込みは178兆2,000億円)。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った。出合いの中心は0.068%と、先週末同様こじっかりとした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、大手行が年始スタートの1M0.118%で調達を行った。

<< 29日のオープン市場動向 >>  
 短国現先レートS/Nは高止まりとなった。一部では短国買入オペ実施を予想する声もあったものの、見送られた。イベントが無い中、3M0.001%の出合いが見られた程度で、終始閑散であった。CP市場は償還総額1,200億円程度に対して発行総額は1,400億円程度。年末年始の期間に入ったことで案件数は少なめであった。発行レートは、引き続きやや高め推移となっていた。

<< 30日の材料 >>  
 \*米国10月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数  
 \*米国12月のC B消費者信頼感指数

JGB新発10年債	0.320	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,729.84	▲ 89.12	為替(9時)	120.40-42
						為替(5時)	120.33-35

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	12/19	12/22	12/24	12/25	12/26	12/29
日銀当預残	1,748,600	1,791,900	1,784,800	1,796,500	1,790,600	1,781,800
準備預金残	1,578,200	1,631,100	1,624,500	1,631,000	1,627,000	1,614,700
レート	0.065%	0.066%	0.067%	0.068%	0.068%	0.068%
月中平均	0.06762%	0.06748%	0.06746%	0.06748%	0.06754%	0.06755%

<<オペ情報、入札結果>>  
 全店共通 8,000億円 1/5 ~ 4/6 (91日間) 応札 2,400億円 落札 2,400億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 国債補完 458億円 12/29 ~ 12/30 (1日間) 応札 10億円 落札 10億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

「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