

《資金需給》

単位 億円

	30日需給速報		5日需給予想		6日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400		7,100		8,000
財政		▲ 5,700		2,100		▲ 2,000
資金過不足		▲ 6,100		9,200		6,000
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				13,000
CP等買入		5,000				
		▲ 5,600		▲ 700		
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						
小計		5,700		▲ 1,600		13,000
当預増減		▲ 400		7,600		19,000

当座預金残高	1,781,400	12/30以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,616,600		25,500
積み終了先	1,314,700	1/5以降の残り所要積立額	
超過準備	1,314,000	積数	10,400
非準備先残高	164,800	1日平均	900
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			1,965,100
準備預金進捗率	99.47% (実績)		64.52% (日数)

12/29のマナターベース		2,758,800	
12/29コール	合計	184,487	無担 66,676 有担 117,811
コール前日増減	計	▲ 1,995	無担 832 有担 ▲ 2,827

12/30の加重平均レート(速報)				12/29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		有担当日分		
0.055	~0.080 (0.066)	0.030	~0.040 (0.031)					O/N	0.050	~0.125 (0.068)
0.120	(0.120)					T/N				
						S/N			0.055	~0.170 (0.109)
						1W			0.118	~0.260 (0.166)
0.118	(0.118)					2W			0.145	(0.145)
0.118	(0.118)					3W				
0.118	(0.118)			0.08-0.12	-	1M			0.118	~0.145 (0.118)
				0.08-0.12	-	2M				
				0.08-0.12	0.001-0.005	3M				
				-	-	6M				
				-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債買入	4,500億円	1/6	応札	9,319億円	落札	4,504億円	按分利回り較差	0.013%	79.2%	平均利回り較差	0.014%
国債買入	4,500億円	1/6	応札	8,119億円	落札	4,501億円	按分利回り較差	0.003%	55.7%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	1/6	応札	15,436億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	-0.007%	72.5%	平均利回り較差	-0.007%

「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

《 1/5の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,789,000	前日比	7,600
O/N	0.05~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

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。

《 30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、131兆9,000億円(当座預金残高見込みは178兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀業態の0.055~0.06%での出合いで立ち上がった。一巡後、大手行が0.065~0.068%の調達希望を示し、一部で0.07%を超える出合いが見られるなど、想定よりもやや強めの地合いで推移し、本年の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が2Wおよび1M0.118%で調達を行った。

《 30日のオープン市場動向 》  
短国現先レートは前日から小幅低下したが、引き続き高め水準であった。年内最終営業日で参加者が少なく、短国アウトライイト市場では3M0.001~0.005%で小額の出合いが見られるにとどまった。CP市場は、償還総額300億円程度に対し、発行総額400億円程度となった。発行レートは横ばい圏で推移した。

《 31日の材料 》  
\*米国12月のシカゴPM景況感指数

《 2日の材料 》  
\*米国11月の建設支出  
\*米国12月のISM製造業景況指数

《 5日の材料 》  
\*特にありません

《コール12月の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	0.06745%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06776%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.325	0.005	日経平均株価(終値)	17,450.77	▲ 279.07	為替(9時)	120.61-64
						為替(5時)	119.79-81

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	12/22	12/24	12/25	12/26	12/29	12/30
日銀当預残	1,791,900	1,784,800	1,796,500	1,790,600	1,781,800	1,781,400
準備預金残	1,631,100	1,624,500	1,631,000	1,627,000	1,615,300	1,616,600
レート	0.066%	0.067%	0.068%	0.068%	0.068%	0.066%
月中平均	0.06748%	0.06746%	0.06748%	0.06754%	0.06755%	0.06745%

本年も大変お世話になり、ありがとうございました。来年もよろしくお願ひ申し上げます。