

**<<資金需給>>**

単位 億円

	1日需給速報		2日需給予想	3日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 900	▲ 2,000
財政		▲ 16,500	▲ 71,700	3,000
資金過不足		▲ 17,100	▲ 72,600	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
64,615				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		2,500		
国庫短期証売却				
国債買入			11,100	
CP等買入				
		▲ 100	▲ 200	
貸出支援基金				
(成長) 51,505				
(増加) 252,028				
被災地支援				
3,161				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給		200		
小計		2,600	10,900	0
当増減		▲ 14,500	▲ 61,700	1,000

<< 12/2の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,382,400	前日比	▲ 61,700
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 1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、前日比6,000億円減の184兆円(当座預金残高見込みは、244兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託、証券業態の0.075~0.077%、大手行からは0.075%の調達希望。出合いの中心は0.076~0.077%と昨日とほぼ同水準の立ち上がりとなった。一巡後は0.07~0.075%での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが散見される程度であった。

<< 1日のオープン市場動向 >>

現先S/N物は低位横ばい圏で推移。短国市場は動意に乏しく終日閑散。CP市場は石油・電力・商社業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は1,500億円程度まで膨らんだ。発行レートは一部の銘柄で小幅低下する動きが見られたが、概ね横ばい圏での取引となった。

<< 2日の材料 >>

- \*岩田副総裁、岡山県金融経済懇談会にて講演
- \*11月のマネタリーベース
- \*11月実績/12月見込み財政資金対民間収支
- \*米国バージュブック
- \*ユーロ圏11月の消費者物価指数速報値

<< コール11月の加重平均レート >>

(土日を含む)	無担	0.07763%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07811%	有担	0.03100%

当座預金残高	2,444,100	12/1以降の残り所要積立額	7,300
準備預金残高	2,233,300	12/2以降の残り所要積立額	5,600
積み終了先	1,833,400	積数	400
超過準備	1,833,300	1日平均	1,961,300
非準備先残高	210,800		
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)			
準備預金進捗率	99.71% (実績)	53.33% (日数)	

JGB新発10年債	0.320	0.020	日経平均株価(終値)	20,012.40	264.93	為替(9時)	123.20-22
						為替(5時)	122.86-87

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	11/24	11/25	11/26	11/27	11/30	12/1
日銀当預残	2,451,700	2,449,300	2,458,300	2,439,900	2,458,600	2,444,100
準備預金残	2,234,200	2,231,600	2,241,800	2,222,300	2,249,100	2,233,300
レート	0.078%	0.078%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07783%	0.07784%	0.07777%	0.07769%	0.07763%	0.07600%

11/30のマネタリーベース				3,436,800		
11/30コール	合計	195,319	無担	58,497	有担	136,822
コール前日増減	計	▲ 6,881	無担	▲ 4,685	有担	▲ 2,196

12/1の加重平均レート(速報)				11/30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		
0.060 ~0.080 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.080 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)		
0.073 ~0.121 (0.079)				T/N		0.030 ~0.125 (0.078)		
				S/N				
0.155 (0.155)				1W	0.117 (0.117)	0.081 ~0.117 (0.098)		
0.160 ~0.165 (0.162)				2W		0.340 (0.340)		
				3W				
		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	-	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<< オペ情報、入札結果 >>

国債補完 4,000億円 12/1 ~ 12/2 (1日間) 応札 30億円 落札 30億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)  
 米ドル資金供給(固定金利方式) 12/3~12/10 (7日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.620%  
 10年利付国債(表面利率0.3%) 応札7兆7,262億円 落札2兆1,725億円(I非競争入札:2,208億円) 12/21~2025/12/20 0.322% 按分39.9290% 平均0.320%

「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