

**<<資金需給>>**

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 1,100	▲ 2,000
財政		▲ 900	▲ 3,600	4,000
資金過不足		▲ 1,300	▲ 4,700	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		500	13,200	
64,485		▲ 600	▲ 9,400	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			5,000	
国庫短期証売却				
国債買入			11,000	
CP等買入				5,000
		▲ 300	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 252,028				
被災地支援				
3,161				
社債等買入			▲ 100	
ETF買入		200	300	
国債補完供給		100		
小計		▲ 100	19,700	5,000
当増減		▲ 1,400	15,000	7,000

12/8の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,408,300	前日比	15,000
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。

<< 7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、前営業日比1,000億円減の178兆8,000億円(当座預金残高見込みは、239兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託、証券業態の0.074~0.076%、大手行からは0.075%の調達希望。出合いの中心は0.075~0.076%と先週末と同様やや弱めの立ち上がりとなった。また、一部業態が試し取りと見られる調達を行った。一巡後はビッドが薄くなり、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、大手行が1W物0.117%で調達を行った。

<< 7日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、動意に乏しく、出合いの見られない閑散としたマーケットとなった。CP発行市場は、償還1,200億円強に対して、発行は1,500億円弱。発行レートは、引き続き年越え物を中心に需要が強く、低位横ばい圏での推移となった。

<< 8日の材料 >>

- \*7-9月期のGDP2次速報(市場予想：前期比年率+0.1%)
- \*10月の国際収支
- \*11月の景気ウォッチャー調査
- \*ユーロ圏7-9月期のGDP改定値
- \*国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、12/10発行)
- \*30年利付国債入札(8,000億円、12/21発行)

当座預金残高	2,393,300	12/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,173,100		1,800
積み終了先	1,783,900	12/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,783,900	積数	1,500
非準備先残高	220,200	1日平均	200
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)			1,969,500
準備預金進捗率	99.92% (実績)		73.33% (日数)

JGB新発10年債	0.325	▲ 0.001	日経平均株価(終値)	19,698.15	193.67	為替(9時)	123.18-20
						為替(5時)	123.27-28

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	11/30	12/1	12/2	12/3	12/4	12/7
日銀当預残	2,458,600	2,444,100	2,379,500	2,380,600	2,394,700	2,393,300
準備預金残	2,249,100	2,233,300	2,169,700	2,171,800	2,182,900	2,173,100
レート	0.076%	0.076%	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07763%	0.07600%	0.07650%	0.07667%	0.07633%	0.07643%

12/4のマナターベース			3,378,100			
12/4コール	合計	213,094	無担	72,805	有担	140,289
コール前日増減	計	7,934	無担	6,124	有担	1,810

12/7の加重平均レート(速報)				12/4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 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.080 (0.076)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.074 ~0.121 (0.077)				T/N		0.072 ~0.120 (0.077)		
				S/N		0.121 (0.121)		
0.081 ~0.155 (0.106)				1W		0.078 ~0.130 (0.079)		
0.073 ~0.160 (0.116)				2W		0.075 ~0.160 (0.098)		
				3W				
0.170 (0.170)		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 12/7 ~ 12/8 (1日間) 応札 8億円 落札 8億円 -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