

<<資金需給>>

単位 億円

	28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		▲ 3,700	▲ 3,600	0
財政		▲ 4,200	▲ 5,100	▲ 1,000
資金過不足		▲ 7,900	▲ 8,700	▲ 1,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		63,715		
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		5,200		10,800
CP等買入				5,500
貸出支援基金(成長)		▲ 1,100	▲ 800	
(増加) 271,714				
被災地支援		3,143		
社債等買入				
ETF買入			200	
国債補完供給				
小計		4,100	4,400	16,300
当預増減		▲ 3,800	▲ 4,300	15,300

<< 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	2,526,900	前日比	▲ 4,300
O/N	0.07~0.08	T/N	0.001~0.06	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.07%台前半での出合いが中心になると見込まれる。					

<< 28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1,000億円減の185兆8,000億円(当座預金残高見込みは、253兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.073~0.075%、大手行から0.07~0.072%の調達希望。出合いの中心は0.073~0.074%となった。一巡後は徐々にビッドが消え、0.07%台前半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、目立った出合いは見られなかった。

<< 28日のオープン市場動向 >>

現先S/Nは、末初取引にあたりレートは低下した。短国市場は3M物で▲0.055~▲0.045%の出合いが見られた程度と閑散であった。CP市場は鉄鋼、石油、ノンバンク業態からの大型発行案件が見られたことで、発行総額は7,500億円程度となったものの、年末発行のため大幅な償還超となった。発行レートは、一時の過熱感が一服し、全体的にやや上昇基調となった。

<< 29日の材料 >>

*10月のS & P/ケース・シラー住宅価格指数

当座預金残高	2,531,200	12/28以降の残り所要積立額	7,800
準備預金残高	2,312,200	12/29以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,856,600	積数	3,900
超過準備	1,856,000	1日平均	200
非準備先残高	219,000	積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)	2,041,100
準備預金進捗率	99.81%	(実績)	41.94%
		(日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.23-26
0.265 ▲ 0.010	18,873.35 104.29	為替(5時)	120.57-58

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	12/21	12/22	12/24	12/25	12/28
日銀当座預金	2,479,800	2,531,900	2,527,300	2,536,100	2,535,000	2,531,200
準備預金残高	2,255,500	2,308,000	2,304,700	2,302,600	2,313,600	2,312,200
レート	0.075%	0.075%	0.074%	0.086%	0.073%	0.073%
月中平均	0.07670%	0.07662%	0.07639%	0.07679%	0.07637%	0.07625%

12/25のマナターベース		3,559,100	
12/25コール合計	218,381	無担	73,524
有担	144,857		
コール前日増減	計 ▲ 12,305	無担 ▲ 13,025	有担 720

12/28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		有担当日分
0.060 ~0.125 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)					O/N	0.030 ~0.121 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.121 (0.084)						T/N		
0.002 ~0.010 (0.005)						S/N	0.071 ~0.125 (0.107)	
0.010 ~0.070 (0.037)						1W	0.125 (0.125)	
0.072 (0.072)						2W	0.118 (0.118)	
						3W	0.077 (0.077)	
		0.07-0.12	-			1M	0.155 ~0.160 (0.158)	有担先日付分
		0.07-0.11	-			2M		
		0.07-0.11	▲0.055-▲0.045			3M		
		-	-			6M		
		-	-			1Y		

<< オペ情報、入札結果 >>

国債補完	8,000億円	12/28	~ 12/29 (1日間) 応札	46億円	落札	46億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	3,500億円	12/30	応札	10,991億円	落札	3,502億円	按分利回り較差	0.010%	1.9%	平均利回り較差	0.012%
国債買入	3,500億円	12/30	応札	11,174億円	落札	3,505億円	按分利回り較差	0.002%	15.6%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,400億円	12/30	応札	6,484億円	落札	2,407億円	按分利回り較差	-0.007%	2.1%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	1,400億円	12/30	応札	5,263億円	落札	1,406億円	按分利回り較差	0.002%	27.0%	平均利回り較差	0.003%

「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録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