

《資金需給》

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 3,500	▲ 300	8,000
財政		▲ 4,600	▲ 8,200	▲ 1,000
資金過不足		▲ 8,100	▲ 8,500	7,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				1,300
63,715				▲ 1,500
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			11,200	
CP等買入			5,500	
		▲ 800	▲ 4,700	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (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		▲ 100	100	
小計		4,300	12,100	▲ 200
当預増減		▲ 3,800	3,600	6,800

《 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	2,531,000	前日比	3,600
O/N	0.001~0.06	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
年末初物となる無担O/Nは、0.001~0.06%程度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、前日比3,000億円増の186兆1,000億円(当座預金残高見込みは、252兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行、地銀、信託から0.07~0.074%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。

《 29日のオープン市場動向 》  
 現先レートS/Nは末初を越えた取引となったことで上昇した。短国市場は受渡ベースが年明けとなったものの、特段出合いは見られず、また一部で予想されていた短国買入オペのオファーも無く、様子見閑散となった。CP市場は石油、食料品業態からの大型発行案件が見られ、発行総額は1,400億円程度となった。発行レートは受渡が年明けとなったことに加え、年末で市場参加者が少なかったため上昇した。

《 30日の材料 》  
 \*米国12月のCB消費者信頼感指数

当座預金残高	2,527,400	12/29以降の残り所要積立額	3,900
準備預金残高	2,308,000	12/30以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,860,700	積数	1,400
超過準備	1,860,600	1日平均	100
非準備先残高	219,400		
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	99.93% (実績)	45.16% (日数)	

JGB新発10年債	0.265	0.000	日経平均株価(終値)	18,982.23	108.88	為替(9時)	120.34-36
						為替(5時)	120.36-37

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	12/21	12/22	12/24	12/25	12/28	12/29
日銀当預残	2,531,900	2,527,300	2,536,100	2,535,000	2,531,200	2,527,400
準備預金残	2,308,000	2,304,700	2,302,600	2,313,600	2,312,200	2,308,000
レート	0.075%	0.074%	0.086%	0.073%	0.073%	0.073%
月中平均	0.07662%	0.07639%	0.07679%	0.07637%	0.07625%	0.07614%

12/28のマネタリーベース				3,559,000
12/28コール	合計	210,337	無担	72,477
			有担	137,860
コール前日増減	計	▲ 8,044	無担	▲ 1,047
			有担	▲ 6,997

12/29の加重平均レート(速報)				12/28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
0.050 ~0.080 (0.073)	0.030	~0.040	(0.031)			0.060 ~0.125 (0.073)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.010 ~0.125 (0.039)							0.073 ~0.121 (0.084)		
							0.001 ~0.010 (0.004)		
0.060 ~0.155 (0.071)							0.010 ~0.070 (0.037)		
0.160 (0.160)							0.072 (0.072)		
0.180 ~0.200 (0.193)				0.07-0.12	-				有担先日付分
				0.07-0.11	-				
				0.07-0.11	-				
				-	-				
				-	-				

《オペ情報、入札結果》

全店共通	8,000億円	1/4	~	4/4	(91日間)	応札	1,300億円	落札	1,300億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	8,000億円	12/29	~	12/30	(1日間)	応札	47億円	落札	47億円	-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