

2015/12/30(水)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	30日需給速報 即日 金額	4日需給予想 金額	5日当社予想 金額
銀行券	0	6,100	8,000
財政	▲ 9,300	2,100	▲ 1,000
資金過不足	▲ 9,300	8,200	7,000
貸出			
売出手形 0			
本店共通 0			
全店共通 0			
共通(固定) 63,715		1,300 ▲ 1,500	
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	11,200		11,000
CP等買入	5,500 ▲ 4,700	▲ 300	
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			
国債補完供給	100		
小計	12,100	▲ 500	11,000
当預増減	2,800	7,700	18,000

当座預金残高	2,530,200	12/30以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,306,500		1,400
積み終了先	1,857,500	1/4以降の残り所要積立額	
超過準備	1,857,400	積数	400
非準預先残高	223,700	1日平均	0
積み期間(12/16～1/15)の所要準備額(積数)	2,042,000		
準備預金進捗率	99.98%	(実績)	61.29% (日数)

12/29のマネタリーベース	3,558,600
12/29コール 合計	200,405 無担 69,836 有担 130,569
コール前日増減 計	▲ 9,932 無担 ▲ 2,641 有担 ▲ 7,291

12/30 の加重平均レート(速報)				12/29 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	有担先日付分	
0.004 ～0.079 (0.038)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N	0.050 ～0.080 (0.073)		0.030 ～0.040 (0.031)	
0.073 ～0.121 (0.099)				T/N		0.010 ～0.125 (0.039)		
				S/N				
0.155 (0.155)				1W	0.155 (0.155)	0.060 ～0.130 (0.067)		
				2W		0.160 (0.160)		
				3W				
0.116 (0.116)		0.07-0.12	-	1M		0.180 ～0.200 (0.193)	有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	-	3M				
		-	▲0.108	6M				
		-	▲0.119-▲0.11	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債買入	3,500億円	1/5	応札	11,666億円	落札	3,501億円	按分利回り較差	0.012%	99.0%	平均利回り較差	0.012%
国債買入	3,500億円	1/5	応札	14,681億円	落札	3,505億円	按分利回り較差	0.003%	40.9%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	1/5	応札	14,743億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	0.005%	20.0%	平均利回り較差	0.006%

「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

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。

《 1/4の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,537,900	前日比	7,700
O/N	0.07～0.08	T/N	0.07～0.12	S/N	0.07～0.12
無担O/Nは、0.07～0.08%程度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、前日比5,000億円増の186兆6,000億円（当座預金残高見込みは、253兆1,000億円）。朝方の無担O/Nは、大手行、地銀、信託から0.003～0.03%の調達希望。出合いの中心は0.01～0.03%となった。一巡後は徐々にビッドアップし、0.03～0.07%程度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。

《 30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。短国市場は年末で市場参加者が少なく閑散とした中、引け際に1Y物で▲0.119～▲0.11%、6M物で▲0.108%の出合いが少額見られた程度であった。CP市場は年末休暇となっている事業法人も多く、発行総額は400億円弱と閑散だった。発行レートは、発行残高が積みあがっている先で上昇する銘柄が見られた。

《 31日の材料 》

*米国12月のシカゴPM景況感指数
 *ユーロ圏休日 (New Year's Eve)

《 1月4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

《コール12月の加重平均レート》

(土日を含む)	無担	0.07368%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07486%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.52-54
0.265	0.000	為替(5時)	120.41-42

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	12/28	12/29	12/30
日銀当預残	2,527,300	2,536,100	2,535,000	2,531,200	2,527,400	2,530,200
準備預金残	2,304,700	2,302,600	2,313,600	2,312,200	2,308,200	2,306,500
レート	0.074%	0.086%	0.073%	0.073%	0.073%	0.038%
月中平均	0.07639%	0.07679%	0.07637%	0.07625%	0.07614%	0.07368%