

## CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/12/1(月) &lt;&lt;セントラル短資株式会社&gt;&gt;

## &lt;&lt;資金需給&gt;&gt;

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          |        | ▲ 300    | ▲ 700    | ▲ 1,000  |
| 財政           |        | ▲ 18,400 | ▲ 17,000 | ▲ 25,000 |
| 資金過不足        |        | ▲ 18,700 | ▲ 17,700 | ▲ 26,000 |
| 貸出           |        |          |          |          |
| 売出手形         |        |          |          |          |
| 0            |        |          |          |          |
| 本店共通         |        |          |          |          |
| 0            |        |          |          |          |
| 全店共通         |        |          |          |          |
| 0            |        |          |          |          |
| 共通(固定)       |        | 2,100    |          |          |
| 80,577       |        | ▲ 1,500  |          |          |
| 国債買現         |        |          |          |          |
| 0            |        |          |          |          |
| CP買現         |        |          |          |          |
| 0            |        |          |          |          |
| 国庫短期証買入      |        |          | 10,000   |          |
| 国庫短期証売却      |        |          |          |          |
| 国債買入         |        | 8,600    |          | 10,100   |
| CP等買入        |        |          |          |          |
|              |        | ▲ 700    | ▲ 200    |          |
| 貸出支援基金       |        |          |          |          |
| (成長) 38,608  |        |          |          |          |
| (増加) 159,053 |        |          |          |          |
| 被災地支援        |        |          |          |          |
| 3,246        |        |          |          |          |
| 社債等買入        |        |          |          |          |
| ETF買入        |        | 300      | 300      |          |
| 国債補完供給       |        |          |          |          |
| 小計           |        | 8,800    | 10,100   | 10,100   |
| 当預増減         |        | ▲ 9,900  | ▲ 7,600  | ▲ 15,900 |

|                             |           |                |             |
|-----------------------------|-----------|----------------|-------------|
| 当座預金残高                      | 1,692,900 | 12/1以降の残り所要積立額 |             |
| 準備預金残高                      | 1,548,600 |                | 26,700      |
| 積み終了先                       | 1,304,300 | 12/2以降の残り所要積立額 |             |
| 超過準備                        | 1,304,300 | 積数             | 22,500      |
| 非準備先残高                      | 144,300   | 1日平均           | 1,600       |
| 積み期間(11/16～12/15)の所要準備額(積数) |           |                | 1,874,400   |
| 準備預金進捗率                     | 98.80%    | (実績)           | 53.33% (日数) |

|                |                              |
|----------------|------------------------------|
| 11/28のマネタリーベース | 2,626,900                    |
| 11/28コール 合計    | 199,611 無担 79,552 有担 120,059 |
| コール前日増減 計      | ▲ 3,666 無担 ▲ 3,973 有担 307    |

| 12/1 の加重平均レート(速報)    |                      |           |               | 11/28 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                |        |
| 0.055 ～0.135 (0.065) | 0.030 ～0.040 (0.031) |           |               | O/N                | 0.050 ～0.135 (0.067) |                      | 0.030 ～0.040 (0.031) |        |
| 0.063 ～0.120 (0.072) |                      |           |               | T/N                |                      | 0.060 ～0.120 (0.071) |                      |        |
|                      |                      |           |               | S/N                |                      |                      |                      |        |
| 0.117 ～0.400 (0.208) |                      |           |               | 1W                 |                      | 0.125 (0.125)        |                      |        |
| 0.240 (0.240)        |                      |           |               | 2W                 |                      | 0.118 ～0.340 (0.139) |                      |        |
|                      |                      |           |               | 3W                 |                      |                      |                      |        |
|                      |                      | 0.08-0.12 | -             | 1M                 |                      |                      | 有担先日付分               |        |
|                      |                      | 0.08-0.12 | -             | 2M                 |                      |                      |                      |        |
|                      |                      | 0.08-0.12 | ▲0.050～▲0.045 | 3M                 |                      |                      |                      |        |
|                      |                      | -         | -             | 6M                 |                      |                      |                      |        |
|                      |                      | -         | -             | 1Y                 |                      |                      |                      |        |

## &lt;&lt;オペ情報、入札結果&gt;&gt;

|      |         |      |    |          |    |         |         |         |       |         |        |
|------|---------|------|----|----------|----|---------|---------|---------|-------|---------|--------|
| 国債買入 | 1,100億円 | 12/3 | 応札 | 1,738億円  | 落札 | 1,100億円 | 按分利回り較差 | -0.039% | 79.1% | 平均利回り較差 | 0.013% |
| 国債買入 | 4,500億円 | 12/3 | 応札 | 11,090億円 | 落札 | 4,501億円 | 按分利回り較差 | 0.001%  | 91.2% | 平均利回り較差 | 0.002% |
| 国債買入 | 4,500億円 | 12/3 | 応札 | 11,176億円 | 落札 | 4,502億円 | 按分利回り較差 | 0.001%  | 89.5% | 平均利回り較差 | 0.001% |

「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

| << 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 | 1,685,300 | 前日比 | ▲ 7,600   |
| O/N                                 | 0.05～0.07 | T/N    | 0.05～0.12 | S/N | 0.05～0.12 |
| 無担O/Nは0.06～0.065%での出合いが中心になると見込まれる。 |           |        |           |     |           |

## &lt;&lt; 1日のインターバンク市場動向 &gt;&gt;

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前営業日比8,000億円減の131兆1,000億円(当座預金残高見込みは169兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.063～0.065%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。週末要因が剥落した事で、一巡後も0.06%台前半で落ち着いた出合いが続くなか、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

## &lt;&lt; 1日のオープン市場動向 &gt;&gt;

現先取引S/Nは落ち着いた水準で推移した。短国市場は3Mにて▲0.050～▲0.045%の出合いが一部で確認された程度で、全体的に閑散であった。CP発行市場では件数は少ないながらも、機械・電機業態からまとまった額の発行があり、発行総額は1,200億円程度となった。一部の銘柄では発行レートが若干上昇した。

## &lt;&lt; 2日の材料 &gt;&gt;

\*10月の毎月勤労統計調査速報

\*11月のマネタリーベース \*12月の日銀当座預金増減要因見込み

\*米国10月の建設支出

\*10年利付国債入札(24,000億円、12/22発行)

| <<コール11月の加重平均レート>> |    |          |    |          |
|--------------------|----|----------|----|----------|
| (土日を含む)            | 無担 | 0.06483% | 有担 | 0.03100% |
| (営業日のみ)            | 無担 | 0.06489% | 有担 | 0.03100% |

| JGB新発10年債 | 日経平均株価(終値) | 為替(9時)    | 118.85-86 |
|-----------|------------|-----------|-----------|
| 0.425     | 0.005      | 17,590.10 | 130.25    |
|           |            | 為替(5時)    | 118.73-74 |

| 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                             | 11/21     | 11/25     | 11/26     | 11/27     | 11/28     | 12/1      |
| 日銀当預残                          | 1,651,500 | 1,657,000 | 1,688,300 | 1,698,200 | 1,702,800 | 1,692,900 |
| 準備預金残                          | 1,508,000 | 1,513,600 | 1,543,600 | 1,550,600 | 1,561,100 | 1,548,600 |
| レート                            | 0.069%    | 0.065%    | 0.066%    | 0.066%    | 0.067%    | 0.065%    |
| 月中平均                           | 0.06446%  | 0.06448%  | 0.06454%  | 0.06459%  | 0.06483%  | 0.06500%  |