

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/12/2(火) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 800	▲ 1,000	▲ 2,000
財政		▲ 17,000	▲ 35,500	4,000
資金過不足		▲ 17,800	▲ 36,500	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
80,577				
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			10,200	
CP等買入				
		▲ 200	▲ 100	
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		
国債補完供給				
小計		10,100	10,100	0
当増減		▲ 7,700	▲ 26,400	2,000

当座預金残高	1,685,200	12/2以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,545,500		22,500
積み終了先	1,305,700	12/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,305,700	積数	18,800
非準備先残高	139,700	1日平均	1,400
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	99.00%	(実績)	56.67% (日数)

12/1のマナターベース		2,617,300	
12/1コール	合計	201,170	無担 82,034 有担 119,136
コール前日増減	計	1,559	無担 2,482 有担 ▲ 923

12/2 の加重平均レート(速報)				12/1 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 ~ 0.075 (0.065)	0.030 ~ 0.040 (0.031)					O/N 0.055 ~ 0.135 (0.065)		0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.063 ~ 0.120 (0.067)						T/N	0.063 ~ 0.120 (0.072)	
						S/N		
0.087 ~ 0.180 (0.103)						1W	0.117 ~ 0.400 (0.208)	
0.160 ~ 0.310 (0.185)						2W	0.240 (0.240)	
0.118 (0.118)						3W		
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	-	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	-	-	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.050~▲0.048	▲0.050~▲0.048	▲0.050~▲0.048	3M		
		-	-	-	-	6M		
		-	-	-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 12/4~12/11 (7日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.610%
 10年利付国債(表面利率0.50%) 応札6兆6,093億円 落札2兆1,974億円(I 非競争入札:1,952億円) 12/22~2024/12/20 0.4840% 按分88.9323% 平均0.4730%
 ETF買入 374億円 約定日 12/2

「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す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

<< 12/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,658,800	前日比	▲ 26,400
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。					

<< 2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7,000億円減の130兆4,000億円(当座預金残高見込みは168兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・系統業態から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。高水準の当座預金残高を背景に、出合い一巡後も落ち着いた展開のなか、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。

<< 2日のオープン市場動向 >>

現先取引S/Nは昨日同様落ち着いた水準で推移した。短国市場は3M物で▲0.050~▲0.048%の出合いが見られた程度で、動意に乏しい地合いであった。CP発行市場は通信業態などからまとまった額の発行が見られ、発行総額は1,200億円程度となった。レート水準は特段の変化もなく、横ばいであった。

<< 3日の材料 >>

- *米国バージョンブック
- *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
- *米国11月のISM非製造業景況指数
- *交付税特別会計借入(10,500億円、12/11借入)

<<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)	118.32-34
0.415 ▲ 0.010	17,663.22 73.12	為替(5時)	118.81-82

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	11/25	11/26	11/27	11/28	12/1	12/2
日銀当預残	1,657,000	1,688,300	1,698,200	1,702,800	1,692,900	1,685,200
準備預金残	1,513,600	1,543,600	1,550,600	1,561,100	1,549,700	1,545,500
レート	0.065%	0.066%	0.066%	0.067%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06448%	0.06454%	0.06459%	0.06483%	0.06500%	0.06500%