

《資金需給》

単位 億円

	11日需給速報		12日需給予想		15日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 3,200	▲ 3,300	▲ 2,000		
財政		2,400	▲ 5,700	19,000		
資金過不足		▲ 800	▲ 9,000	17,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			3,800			
79,847			▲ 2,600			
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			13,700			
CP等買入						
		▲ 300	▲ 500			
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 159,053						
被災地支援						
3,246						
社債等買入						
ETF買入		200	200			
国債補完供給						
小計		▲ 100	14,600	0		
当増減		▲ 900	5,600	17,000		

12/12の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,678,000	前日比	5,600
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.065%前後の出合いが中心になると見込まれる。

11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1兆4,000億円減の127兆8,000億円(当座預金残高見込みは167兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.063~0.066%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。一巡後は0.06%台前半で散発的に出合いが見られる中、本日の取引を終えた。また、一部邦銀から0.125%、証券からは0.085~0.125%で、まとまった試し取りがみられた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

11日のオープン市場動向
 現先S/N物は小高く推移した。短国市場は、3M物(500回)入札が実施された。入札結果は平均落札利回り▲0.004% 按分落札利回り▲0.0018%と昨日の2M物入札に引き続き堅調な結果となった。セカンダリーは引けにかけて▲0.02%まで買い進まれた。CP市場は、引き合いペースで償還総額3,000億円程度に対し、5・10日発行にあたったことで発行総額は2,700億円強となった。発行レートは横ばい圏での動きとなっていた。

12日の材料
 *10月の石油等消費動態統計
 *米国11月の生産者物価指数
 *米国12月のミシガン大消費者信頼感指数速報

当座預金残高	1,672,400	12/11以降の残り所要積立額	4,000
準備預金残高	1,514,900	12/12以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,278,200	積数	3,300
超過準備	1,278,200	1日平均	800
非準備先残高	157,500	積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,887,600
準備預金進捗率	99.83% (実績)		86.67% (日数)

JGB新発10年債	0.405	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	17,257.40	▲ 155.18	為替(9時)	117.59-63
						為替(5時)	117.93-94

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	12/4	12/5	12/8	12/9	12/10	12/11
日銀当預残	1,659,800	1,681,000	1,663,900	1,686,600	1,673,300	1,672,400
準備預金残	1,514,700	1,537,200	1,522,500	1,539,400	1,528,900	1,514,900
レート	0.065%	0.067%	0.065%	0.073%	0.067%	0.085%
月中平均	0.06500%	0.06586%	0.06575%	0.06656%	0.06660%	0.06827%

12/10のマナタリーベース				2,606,000		
12/10コール	合計	196,368	無担	74,567	有担	121,801
コール前日増減	計	▲ 3,381	無担	▲ 6,572	有担	3,191

12/11の加重平均レート(速報)				12/10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		
0.055 ~0.135 (0.085)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.050 ~0.125 (0.067)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.065 ~0.130 (0.094)				T/N		0.064 ~0.130 (0.087)			
0.125 (0.125)				S/N					
0.075 ~0.250 (0.080)				1W		0.075 (0.075)			
0.160 (0.160)				2W		0.116 (0.116)			
				3W					
0.200 ~0.230 (0.223)		0.08-0.12	-	1M		0.075 (0.075)	有担先日付分		
		0.08-0.12	▲0.02	2M					
		0.08-0.12	▲0.02-▲0.005	3M					
		-	▲0.01-▲0.005	6M					
		-	-	1Y					

《オペ情報、入札結果》

社債買入 750億円 12/17 応札 1,536億円 落札 750億円 按分レート 0.062% 29.9% 平均落札レート 0.106%
 T-Bill3M 応札44兆8,747億8,000万円落札5兆2,800億3,000万円(非競争入札:4,099億円) 12/15~2015/3/23 ▲0.0018%按分35.5446% 平均▲0.0040%
 流動性供給 応札 1兆6,742億円 落札 3,988億円 12/15 募入最大利回較差 ▲0.008% 按分 78.4478% 募入平均利回較差 ▲0.010%

「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