

2014/12/19(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	19日需給速報		22日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 4,300	▲ 3,600	▲ 5,000
財政		2,400	32,200	0
資金過不足		▲ 1,900	28,600	▲ 5,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,000	
81,067			▲ 2,500	
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			18,800	
CP等買入		4,500		
		▲ 700	▲ 1,000	
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789				
被災地支援				
3,246				
社債等買入		▲ 400		
ETF買入			200	
国債補完供給				
小計		3,400	16,500	0
当預増減		1,500	45,100	▲ 5,000

当座預金残高	1,748,600	12/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,577,300		195,000
積み終了先	1,308,800	12/22以降の残り所要積立額	
超過準備	1,281,500	積数	71,400
非準備先残高	171,300	1日平均	2,900
積み期間(12/16～1/15)の所要準備額(積数)			1,964,200
準備預金進捗率	96.36%	(実績)	19.35% (日数)

12/18のマネタリーベース		2,696,500	
12/18コール	合計	186,501	無担 63,825 有担 122,676
コール前日増減	計	▲ 3,201	無担 ▲ 3,186 有担 ▲ 15

12/19 の加重平均レート(速報)					12/18 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 ～0.135 (0.065)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N	0.030 ～0.125 (0.066)		0.030 ～0.040 (0.031)	
0.065 ～0.120 (0.077)				T/N		0.064 ～0.120 (0.089)		
				S/N				
0.117 ～0.270 (0.143)				1W				
0.130 (0.130)				2W		0.080 (0.080)		
0.082 (0.082)				3W		0.115 (0.115)		
0.087 ～0.119 (0.101)		0.08-0.12	-	1M		0.117 ～0.118 (0.117)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
0.200 (0.200)		0.08-0.12	▲0.001-0.000	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.07	1Y				

《オペ情報、入札結果》

本日は日本銀行による調節はありませんでした。

<日銀金融政策決定会合・結果>

・マネタリーベースが、年間約80兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(賛成8反対1)

・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)

①長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。

ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。

買入れの平均残存期間は7年～10年程度とする。

②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約3兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。

③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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

《 12/22の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,793,700	前日比	45,100
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%近辺の出合いが中心になると見込まれる。					

《 19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、132兆7,000億円(当座預金残高見込みは174兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行から0.06%台半ばでのビッドが提示される事が想定されていた為か、信託業態から0.065～0.067%、地銀業態からは0.063～0.065%と昨日よりも強めの調達希望で始まり、出合いの中心は0.065～0.067%となった。しかし、予想に反して大手行が0.06%のビッドを提示したため、一斉に調達レートが切り下がり、その後は0.063～0.064%での出合いとなり、前場の取引を終えた。後場に入ると目立った出合いはなく、閑散な地合いで週末の取引を終えた。ターム物に関しては、昨日に続き大手行が年内物を0.117%で調達を行った。本日の金融政策決定会合では現状維持が決定された。

《 19日のオープン市場動向 》

現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、3Mで▲0.001～0.000%の出合いが見られた程度であった。CP市場は、機械、ノンバンク業態から大型発行案件が見られた。2,500億円程度の償還に対して、4,500億円強の発行となり、大幅な発行超であった。発行レートは総じて横ばいで推移した。

《 22日の材料 》

*日銀金融経済月報

*米国11月の中古住宅販売

《コール11月積み期間分の加重平均レート》

(土日を含む)	無担	0.06747%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06735%	有担	0.03100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	118.94-95
0.355	0.005	17,621.40	411.35	為替(5時)	119.17-18

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	12/12	12/15	12/16	12/17	12/18	12/19
日銀当預残	1,678,200	1,691,600	1,742,500	1,743,900	1,747,100	1,748,600
準備預金残	1,529,800	1,550,400	1,587,400	1,586,800	1,588,500	1,577,300
レート	0.068%	0.069%	0.067%	0.068%	0.066%	0.065%
月中平均	0.06821%	0.06827%	0.06819%	0.06818%	0.06806%	0.06762%