

<<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		7日需給予想	8日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,400	▲ 300	▲ 1,000
財政		6,400	▲ 100	3,000
資金過不足		5,000	▲ 400	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			500	13,200
64,615			▲ 600	▲ 9,400
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				5,000
国庫短期証売却				
国債買入		4,900		10,800
CP等買入				
		▲ 400	▲ 300	
貸出支援基金		11,000		
(成長) 58,484				
(増加) 252,028		▲ 6,800		
被災地支援				
3,161				
社債等買入				
ETF買入		500	200	
国債補充供給	即日	▲ 100	100	
小計		9,100	▲ 100	19,600
当預増減		14,100	▲ 500	21,600

当座預金残高	2,394,700	12/4以降の残り所要積立額	3,500
準備預金残高	2,182,900	12/7以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,784,200	積数	1,800
超過準備	1,783,900	1日平均	200
非準預先残高	211,800		
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,961,300		
準備預金進捗率	99.91% (実績)	70.00% (日数)	

12/3のマネタリーベース		3,362,500	
12/3コール 合計	205,160	無担	66,681
		有担	138,479
コール前日増減	計	3,689	無担
		3,673	有担
			16

12/4 の加重平均レート(速報)				12/3 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
0.060 ~0.080 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)					O/N	0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.120 (0.077)						T/N		0.075 ~0.121 (0.078)	
0.121 (0.121)						S/N			
0.078 ~0.130 (0.079)						1W		0.101 ~0.117 (0.117)	
0.075 ~0.160 (0.098)						2W		0.118 (0.118)	
						3W			
				0.07-0.12	-	1M		0.117 ~0.170 (0.126)	有担先日付分
				0.07-0.11	-	2M			
				0.07-0.11	▲0.08-▲0.07	3M			
				-	-	6M			
				-	▲0.07	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	12/8	~ 3/18 (101日間)	応札	13,150億円	落札	13,150億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	4,000億円	12/4	~ 12/7 (3日間)	応札	0億円	落札	0億円		按分	平均	(即)
国債補完	8,000億円	12/4	~ 12/7 (3日間)	応札	95億円	落札	95億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	5,000億円	12/8	応札	18,492億円	落札	5,000億円	全取利回り較差	0.037%		平均利回り較差	0.038%
国債買入	3,500億円	12/8	応札	7,772億円	落札	3,503億円	按分利回り較差	0.004%	41.8%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	3,500億円	12/8	応札	13,210億円	落札	3,501億円	按分利回り較差	0.009%	44.6%	平均利回り較差	0.010%
国債買入	2,400億円	12/8	応札	6,016億円	落札	2,408億円	按分利回り較差	0.013%	33.7%	平均利回り較差	0.016%
国債買入	1,400億円	12/8	応札	4,716億円	落札	1,402億円	按分利回り較差	0.019%	92.6%	平均利回り較差	0.019%
CP買入	5,000億円	12/9	応札	8,611億円	落札	4,995億円	按分レート	0.050%	14.3%	平均落札レート	0.060%
ETF買入	369億円	約定日	12/4								
J-REIT買入	12億円	約定日	12/4								

<< 12/7の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,394,200	前日比	▲ 500
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

<< 4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1兆5,000億円増の178兆9,000億円(当座預金残高見込みは、239兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託、証券業態の0.075~0.076%、大手行からは0.075%の調達希望。出合いの中心は0.075~0.076%と昨日よりもやや弱めの立ち上がりとなった。一巡後は調達レートが切り下がり、0.07~0.075%での出合いが散見されつつ、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが散見される程度であった。

<< 4日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は低位横ばい圏で推移した。短国市場は短国買入オペが5,000億円で実施された。目先の短国買入オペや海外勢の動向が不透明な中、平均落札較差+0.038%・全取利回り較差+0.037%と軟調な結果となった。CP市場は一部大型の発行案件が見られたものの発行総額は500億円程度にとどまった。発行レートは引続き低位横ばい圏で推移。CP等買入オペが実施され、入札結果は平均落札利回り0.060%・按分落札利回り0.050%となった。

- << 7日の材料 >>**
- *黒田日銀総裁、パリ・ユーロプラス・フィナンシャル・フォーラムにて講演
 - *佐藤日銀審議委員、奈良県金融経済懇談会にて講演
 - *10月の景気動向指数速報
 - *11月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 - *米国10月の消費者信用残高
 - *米国11月のF R B労働市場情勢指数

<<コール11月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07763%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07811%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.326	0.011	日経平均株価(終値)	19,504.48	▲ 435.42	為替(9時)	122.64-66
						為替(5時)	122.77-78

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	11/27	11/30	12/1	12/2	12/3	12/4
日銀当預残	2,439,900	2,458,600	2,444,100	2,379,500	2,380,600	2,394,700
準備預金残	2,222,300	2,249,100	2,233,300	2,169,700	2,171,800	2,182,900
レート	0.077%	0.076%	0.076%	0.077%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07769%	0.07763%	0.07600%	0.07650%	0.07667%	0.07633%

「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録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