

<<資金需給>>

単位 億円

	13日需給速報		14日需給予想	17日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	▲ 400	1,000
財政		▲ 5,300	3,100	▲ 55,000
資金過不足		▲ 5,600	2,700	▲ 54,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				3,400
82,820				▲ 4,800
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			7,900	
CP等買入				
		▲ 100	▲ 600	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援				
3,255				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入		100		
国債補完供給				
小計		▲ 100	7,300	▲ 1,400
当預増減		▲ 5,700	10,000	▲ 55,400

<< 11/14の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,703,400	前日比	10,000
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.055~0.06%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 13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1兆1,000億円減少の12兆3,000億円(当座預金残高見込みは16兆9,000億円)。無担O/Nは、地銀・信託業態から0.058~0.059%、大手行から0.055%での調達希望で立ち上がり、出合いの中心レートは0.058~0.059%近辺となった。一巡後は0.055~0.058%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、大手行から2W~1M物のまとまった調達が行われていた。共通担保オペが8,000億円オファーされ、落札総額3,370億円で札割れとなった。

<< 13日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばい圏での推移となった。短国市場は3M物の入札が実施された。W I 取引では0.002%まで買われる場面も見られていたが、平均落札利回り0.0070%、最高落札利回り0.0111%と水準は低いながらも落ち着いた結果となった。セカンダリーではやや買い進まれ、0.001~0.005%の出合いが見られた。C P 市場は、鉄鋼、石油、商社業態からのまとまった発行もあり、発行総額は1,500億円強となった。発行レートは概ね横ばいでの推移となった。

<< 14日の材料 >>
 *9月のマネタリーサーベイ
 *米国9月の企業在庫 *米国10月の小売売上高
 *米国11月のミシガン大消費者信頼感指数速報
 *ユーロ圏7-9月期のGDP速報値
 *ユーロ圏10月の消費者物価指数改定値

当座預金残高	1,693,400	11/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,548,200		700
積み終了先	1,287,300	11/14以降の残り所要積立額	
超過準備	1,286,900	積数	200
非準備先残高	145,200	1日平均	100
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)	1,929,200		
準備預金進捗率	99.99% (実績)	93.55% (日数)	

JGB新発10年債	0.500	▲ 0.025	日経平均株価(終値)	17,392.79	195.74	為替(9時)	115.58-61
						為替(5時)	115.78-79

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	11/6	11/7	11/10	11/11	11/12	11/13
日銀当預残	1,695,100	1,675,400	1,655,700	1,680,800	1,699,100	1,693,400
準備預金残	1,549,300	1,541,800	1,515,700	1,538,000	1,547,300	1,548,200
レート	0.061%	0.062%	0.068%	0.068%	0.065%	0.063%
月中平均	0.06050%	0.06100%	0.06170%	0.06227%	0.06250%	0.06254%

11/12のマネタリーベース				2,612,500		
11/12コール合計	180,752	無担	70,071	有担	110,681	
コール前日増減	計	▲ 1,669	無担	▲ 2,562	有担	893

11/13の加重平均レート(速報)					11/12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 (0.063)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.045 ~0.135 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.060 ~0.121 (0.080)				T/N		0.060 ~0.120 (0.065)		
				S/N				
0.114 ~0.117 (0.116)				1W				
0.116 ~0.121 (0.118)				2W				
				3W		0.075 (0.075)		
0.118 ~0.300 (0.119)		0.08-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.0010-0.0111	3M				
		-	0.0000	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 11/17 ~ 2/16 (91日間) 応札 3,370億円 落札 3,370億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札28兆6,602億7,000万円 落札5兆2,582億3,000万円(非競争入札:4,617億円) 11/17~2015/2/23 0.0111% 按分26.9774% 平均0.0070%
 5年利付国債(表面利率0.2%) 応札9兆2,219億円 落札2兆4,899億円(I非競争入札:2,092億円) 11/17~2019/9/20 0.164% 按分13.2544% 平均0.160%

「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