

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/11/14(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	14日需給速報		17日需給予想	18日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	200	0
財政		3,200	▲ 61,800	▲ 1,000
資金過不足		2,800	▲ 61,600	▲ 1,000
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				12,500
国庫短期証売却				
国債買入		7,900		15,000
CP等買入				
		▲ 600	▲ 400	
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				1,000
ETF買入				
国債補完供給				
小計		7,300	▲ 1,800	28,500
当預増減		10,100	▲ 63,400	27,500

当座預金残高	1,703,500	11/14以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,553,500		200
積み終了先	1,294,700	11/17以降の残り所要積立額	
超過準備	1,294,600	積数	891,800
非準預先残高	150,000	1日平均	30,800
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			1,929,200
11月の新所要見込		62,400	(一日平均)

11/13のマナタリーベース		2,607,200	
11/13コール	合計	181,156	無担 69,996 有担 111,160
コール前日増減	計	404	無担 ▲ 75 有担 479

11/14の加重平均レート(速報)				11/13の加重平均レート(確報)				単位 (%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.040 ~0.135 (0.066)	0.030	~0.040 (0.031)	CP気配a-1	O/N	0.050 ~0.135 (0.063)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.060 ~0.125 (0.085)			短国	T/N		0.060 ~0.121 (0.080)		
				S/N				
0.056 ~0.117 (0.089)				1W		0.114 ~0.117 (0.116)		
0.118 ~0.340 (0.132)				2W		0.116 ~0.121 (0.118)		
				3W				
				1M		0.118 ~0.300 (0.118)		有担先日付分
				2M				
				3M				
				6M				
				1Y				

《オペ情報、入札結果》

国短買入	12,500億円	11/18	応札	21,386億円	落札	12,500億円	按分利回り較差	-0.051%	17.0%	平均利回り較差	-0.026%
国債買入	5,500億円	11/18	応札	12,903億円	落札	5,501億円	按分利回り較差	0.002%	42.4%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	5,500億円	11/18	応札	10,144億円	落札	5,504億円	按分利回り較差	-0.013%	50.4%	平均利回り較差	-0.012%
国債買入	2,400億円	11/18	応札	5,263億円	落札	2,404億円	按分利回り較差	-0.034%	14.3%	平均利回り較差	-0.029%
国債買入	1,600億円	11/18	応札	5,471億円	落札	1,601億円	按分利回り較差	-0.088%	99.3%	平均利回り較差	-0.078%
ETF買入	380億円	約定日	11/14								

《 11/17の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,640,100	前日比	▲ 63,400
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.055~0.06%前後での出合いが中心になると見込まれる。

《 14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1兆8,000億円増加の130兆1,000億円(当座預金残高見込みは170兆3,000億円)。無担O/Nは、大手行から0.06%での調達が入ったことで、他業態も押し上げられるように0.06~0.065%の調達希望で立ち上がり、出合いの中心レートは0.06~0.065%近辺となった。一巡後も0.06%を中心とした出合いで底堅く推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、大手行から1M物の調達が行われた。

《 14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。短国市場は短国買入オペが12,500億円実施された。前回オペ比で15,000億円の減額となったものの、平均利回り較差▲0.026%、按分利回り較差▲0.051%と強めの結果になった。オペ後は3Mが▲0.065%まで買い進まれるなど大幅にレートが低下した。CP市場は、一部大型案件もあり発行総額は1,100億円程度となった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

《 17日の材料 》

*7-9月期のGDP1次速報(市場予想:前期比年率+2.1%)

*米国10月の鉱工業生産・設備稼働率

*預金保険機構借入(12ヶ月程度、11/28借入)

《 コール10月積み期間分の加重平均レート 》

(土日を含む)	無担	0.06119%	有担	0.03035%
(営業日のみ)	無担	0.06138%	有担	0.03052%

JGB新発10年債	0.480	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	17,490.83	98.04	為替(9時)	115.80-81
						為替(5時)	116.29-31

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	11/7	11/10	11/11	11/12	11/13	11/14
日銀当預残	1,675,400	1,655,700	1,680,800	1,699,100	1,693,400	1,703,500
準備預金残	1,541,800	1,515,700	1,538,000	1,547,300	1,548,600	1,553,500
レート	0.062%	0.068%	0.068%	0.065%	0.063%	0.066%
月中平均	0.06100%	0.06170%	0.06227%	0.06250%	0.06254%	0.06319%

「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の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