

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/11/17(月) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想	19日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,200	100	0
財政		▲ 61,600	▲ 500	2,000
資金過不足		▲ 60,400	▲ 400	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		3,400		
81,359		▲ 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			15,800	5,100
CP等買入				
		▲ 400	▲ 100	
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		▲ 1,800	29,200	5,100
当預増減		▲ 62,200	28,800	7,100

当座預金残高	1,641,300	11/17以降の残り所要積立額	891,800
準備預金残高	1,504,800	11/18以降の残り所要積立額	338,500
積み終了先	967,600	積数	12,100
超過準備	706,800	1日平均	12,100
非準預先残高	136,500		
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,872,400		
準備預金進捗率	81.92% (実績)	6.67% (日数)	

11/14のマナタリーベース		2,617,700	
11/14コール 合計	178,790	無担	65,772
有担		有担	113,018
コール前日増減	計	▲ 2,366	無担 ▲ 4,224
			有担 1,858

11/17の加重平均レート(速報)			11/14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 (0.064)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.040 ~0.135 (0.066)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.060 ~0.120 (0.069)					0.060 ~0.125 (0.085)	
0.088 ~0.400 (0.134)		0.08-0.12	-	1W	0.056 ~0.117 (0.089)	
0.245 (0.245)		0.08-0.12	-	2W	0.118 ~0.340 (0.132)	
		0.08-0.12	-	3W		
0.118 (0.118)		-	▲0.06~▲0.05	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分
0.119 (0.119)		-	-	2M		
		-	-	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	11/17 ~ 11/18 (1日間) 応札	3億円	落札	3億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	1,100億円	11/19 応札	3,417億円	落札	1,101億円	按分利回り較差	0.020%	71.7%	平均利回り較差	0.023%
国債買入	4,000億円	11/19 応札	14,842億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.017%	18.6%	平均利回り較差	-0.014%
CP買入	4,000億円	11/20 応札	7,546億円	落札	3,997億円	按分レート	0.063%	33.3%	平均落札レート	0.085%

預借借入(金融再生勘定、金融機能強化勘定) 939億円 11/28 ~2015/11/27 応札 5,457億円 落札939億円 0.090% 按分 27.143% 平均 0.088%

ETF買入 380億円 約定日 11/17

J-REIT買入 12億円 約定日 11/17

「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。」

<< 11/18の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,670,100	前日比	28,800
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.055~0.065%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 17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5兆4,000億円減少の12兆7,000億円(当座預金残高見込みは16兆400億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06%、地銀・信託業態から0.06~0.063%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.06%を中心とした出合い。都銀業態のビッドが下支えとなり、一巡以降も0.06%での出合いを中心として推移した。ターム物は1M物で大手行によるまとまった調達が確認された。

<< 17日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは、概ね横ばい圏の推移となった。短国市場は、6Mで▲0.06~▲0.05%での出合いが見られたものの、全体としては閑散であった。CP市場は、鉄鋼・ノンバンク業態から大型の調達が実施され、発行総額は1,700億円程度となった。発行レートは概ね横ばい。本日はCP等買入オペが実施され、按分レート0.063%、平均落札レート0.085%、按分率33.3%という結果になった。

<< 18日の材料 >>

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、19日まで)
- *米国10月の生産者物価指数 *英国10月の消費者物価指数
- *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、11/20発行)
- *20年利付国債入札(12,000億円、11/20発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	116.87-88
0.475 ▲ 0.005	16,973.80 ▲ 517.03	為替(5時)	115.94-95

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	11/10	11/11	11/12	11/13	11/14	11/17
日銀当預残	1,655,700	1,680,800	1,699,100	1,693,400	1,703,500	1,641,300
準備預金残	1,515,700	1,538,000	1,547,300	1,548,600	1,555,800	1,504,800
レート	0.068%	0.068%	0.065%	0.063%	0.066%	0.064%
月中平均	0.06170%	0.06227%	0.06250%	0.06254%	0.06319%	0.06324%

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