

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/11/19(水) <<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		20日需給予想	21日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 500	▲ 2,100	▲ 2,000
財政		▲ 2,900	▲ 23,300	2,000
資金過不足		▲ 3,400	▲ 25,400	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
81,359				
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		5,300		
CP等買入			4,000	
		▲ 500	▲ 1,000	
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				
ETF買入		100		
国債補充供給				
小計		4,900	3,000	0
当預増減		1,500	▲ 22,400	0

当座預金残高	1,671,700	11/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,530,800		239,600
積み終了先	1,233,900	11/20以降の残り所要積立額	
超過準備	1,229,500	積数	184,700
非準備先残高	140,900	1日平均	7,100
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	90.14% (実績)		13.33% (日数)

11/18のマナタリーベース		2,583,100	
11/18コール	合計	191,789 無担	77,409 有担
11/18コール	前日増減	計	3,383 無担
			4,193 有担
			▲ 810

11/19の加重平均レート(速報)			11/18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 ~0.125 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.125 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.062 ~0.125 (0.077)					0.061 ~0.120 (0.077)	
					0.090 (0.090)	
				0.160 (0.160)	0.145 ~0.310 (0.178)	
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-		0.118 (0.118)	有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	▲0.08~▲0.075			
		-	-			
		-	▲0.035~▲0.025			

## <<オペ情報、入札結果>>

J-REIT買入 12億円 約定日 11/19

### <<日銀金融政策決定会合・結果>>

・マナタリーベースが、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

<< 11/20の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,649,300	前日比	▲ 22,400
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.055~0.065%前後で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、前日比3,000億円増加の129兆1,000億円(当座預金残高見込みは167兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06%、地銀・信託業態から0.06~0.062%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.06~0.062%を中心とした出合い。都銀業態のビッドが下支えとなり、0.06%を中心とした出合いで推移した。ターム物は動意に乏しい展開であった。本日の日銀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 >>

現先レートS/Nは、横ばい圏で推移した。短国市場は、アウトライトで3M:▲0.080%、1Y:▲0.035%まで買い進まれる場面もみられたものの、全般的には閑散であった。CP市場は、機械・化学・ノンバンク業態等から大型の発行が実施され、発行総額は2,700億円程度であった。発行レートは横ばい圏での推移となっていた。

### << 20日の材料 >>

\*日銀金融経済月報

\*10月の貿易統計

\*米国10月の消費者物価指数 \*米国10月の中古住宅販売

\*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、11/25発行)

\*流動性供給入札(4,000億円、11/25発行)

### <<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 ▲ 0.030	17,288.75 ▲ 55.31	為替(5時)	117.36-38

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	11/12	11/13	11/14	11/17	11/18	11/19
日銀当預残	1,699,100	1,693,400	1,703,500	1,641,300	1,670,200	1,671,700
準備預金残	1,547,300	1,548,600	1,555,800	1,506,800	1,536,400	1,530,800
レート	0.065%	0.063%	0.066%	0.064%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06250%	0.06254%	0.06319%	0.06324%	0.06333%	0.06342%

11/19の加重平均レート(速報)			11/18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 ~0.125 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.125 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.062 ~0.125 (0.077)					0.061 ~0.120 (0.077)	
					0.090 (0.090)	
				0.160 (0.160)	0.145 ~0.310 (0.178)	
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-		0.118 (0.118)	有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	▲0.08~▲0.075			
		-	-			
		-	▲0.035~▲0.025			

## <<オペ情報、入札結果>>

J-REIT買入 12億円 約定日 11/19

### <<日銀金融政策決定会合・結果>>

・マナタリーベースが、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