

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/11/26(水) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	26日需給速報		27日需給予想		28日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	▲ 2,200	▲ 1,600		
財政		▲ 1,000	1,000	5,200		
資金過不足		▲ 1,900	▲ 1,200	3,600		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
79,977						
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入		25,000				
国庫短期証売却						
国債買入		8,600	11,300			
CP等買入				4,000		
		▲ 200	▲ 500			
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053						
被災地支援		3,255			0	
社債等買入						
ETF買入				200		
国債補完供給	即日	▲ 200	200			
小計		33,200	11,200	4,000		
当預増減		31,300	10,000	7,600		

当座預金残高	1,688,300	11/26以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,542,500		49,900
積み終了先	1,294,700	11/27以降の残り所要積立額	
超過準備	1,294,700	積数	44,700
非準備先残高	145,800	1日平均	2,400
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	97.61% (実績)		36.67% (日数)

11/25のマナリーベース		2,575,900	
11/25コール	合計	198,592	無担 82,405 有担 116,187
コール前日増減	計	3,404	無担 2,627 有担 777

11/26 の加重平均レート(速報)			11/25 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 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.135 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.120 (0.092)				T/N	0.064 ~0.120 (0.076)	
				S/N		
				1W	0.083 ~0.117 (0.088)	
0.116 (0.116)				2W	0.160 ~0.245 (0.210)	
				3W	0.140 (0.140)	
0.230 ~0.235 (0.232)		0.08-0.12	-	1M	0.160 (0.160)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	-	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

## <<オペ情報、入札結果>>

国債補完 479億円 11/26 ~ 11/27 (1日間) 応札 121億円 落札 121億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

40年利付国債(表面利率1.7%) 応札 1兆2,689億円 落札 3,996億円 11/28~2054/3/20 1.585% 按分 33.9130%

交付税特会 1兆500億円 12/4~2015/6/4 応札 2兆5,645億円 落札 1兆500億円 0.091% 按分 20.5000% 平均 0.089%

J-REIT買入 12億円 約定日 11/26

<< 11/27の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,698,300	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0.055~0.065%前後での出会いが中心になると見込まれる。

<< 26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3兆6,000億円増加の130兆5,000億円(当座預金残高見込みは168兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06%、地銀・信託業態から0.06~0.064%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.06~0.064%を中心とした出会い。昨日とほぼ同様の展開となり、一日を通して0.06~0.065%の出会いで推移した。ターム物はロール案件の取引が中心となった。

<< 26日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは、月末初の影響から小幅上昇で推移した。短国アウトライイト市場は引き続き出会いなく閑散。CP市場は月末案件が膨らみ8,000億円程度の発行となったものの、投資家・ディーラーともに運用ニーズが強く、発行レートは全般的に小幅低下となった

<< 27日の材料 >>  
 \*米国祝日(Thanksgiving Day)  
 \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、12/1発行)

JGB新発10年債	0.435	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	17,383.58	▲ 24.04	為替(9時)	117.80-82
						為替(5時)	117.74-75

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	11/18	11/19	11/20	11/21	11/25	11/26
日銀当預残	1,670,200	1,671,700	1,648,300	1,651,500	1,657,000	1,688,300
準備預金残	1,536,400	1,532,300	1,497,900	1,508,000	1,513,600	1,542,500
レート	0.065%	0.065%	0.066%	0.069%	0.065%	0.066%
月中平均	0.06333%	0.06342%	0.06355%	0.06446%	0.06448%	0.06454%

「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