

◀ 資金需給 ▶

単位 億円

	28日需給速報		1日需給予想		2日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,000		▲ 300		▲ 1,000
財政		5,800		▲ 18,200		▲ 11,000
資金過不足		3,800		▲ 18,500		▲ 12,000
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)				2,100		
79,977				▲ 1,500		
国債買現		0				
CP買現		0				
国庫短期証買入						10,000
国庫短期証売却						
国債買入				8,600		
CP等買入		4,000		▲ 700		
		▲ 3,200				
貸出支援基金(成長)		38,608				
(増加)		159,053				
被災地支援		3,246		0		
社債等買入						
ETF買入				300		
国債補充供給						
小計		800		8,800		10,000
当預増減		4,600		▲ 9,700		▲ 2,000
当座預金残高		1,702,800		11/28以降の残り所要積立額		
準備預金残高		1,561,100		39,700		
積み終了先		1,315,600		12/1以降の残り所要積立額		
超過準備		1,315,400		積数		
非準備先残高		141,700		1日平均		
				1,800		
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)				1,874,400		
準備預金進捗率		98.58%		(実績) 50.00% (日数)		

◀ 12/1の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,693,100	前日比	▲ 9,700
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。					

◀ 28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1兆3,000億円増加の131兆9,000億円(当座預金残高見込みは170兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.065%、地銀・信託業態から0.065~0.067%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.065~0.067%を中心とした出合い。週末要因により都銀から強めのビッドが入ったことで全体の調達レートが底上げされ、一日を通して0.065~0.07%程度の出合いで推移した。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

◀ 28日のオープン市場動向 ▶
 現先レートS/N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実施され、オファー額が前回から1兆5,000億円減額されて1兆円となったことから、平均利回較差・全取利回較差ともに+0.012%と売却ニーズの高さを反映した結果となった。CP市場は石油業態の大型発行を中心に、2,000億円程度の発行が見られた。発行レートは横ばい圏の推移となった。

- ◀ 1日の材料 ▶
- *7-9月期の法人企業統計調査季報
 - *11月実績/12月見込み財政資金対民間収支
 - *米国11月のISM製造業景況指数

◀ コール11月の加重平均レート ▶			
(土日を含む)	無担	0.06483%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06489%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	117.87-88
0.420	0.000	17,459.85	211.35
		為替(5時)	118.21-23

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	11/20	11/21	11/25	11/26	11/27	11/28
日銀当預残	1,648,300	1,651,500	1,657,000	1,688,300	1,698,200	1,702,800
準備預金残	1,497,900	1,508,000	1,513,600	1,543,600	1,550,600	1,561,100
レート	0.066%	0.069%	0.065%	0.066%	0.066%	0.067%
月中平均	0.06355%	0.06446%	0.06448%	0.06454%	0.06459%	0.06483%

11/27のマナリーベース				2,620,200		
11/27コール合計	203,277	無担	83,525	有担	119,752	
コール前日増減	計	2,633	無担	▲ 439	有担	3,072

11/28の加重平均レート(速報)				11/27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	有担先日付分		
0.050 ~0.135 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.050 ~0.125 (0.066)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.060 ~0.120 (0.071)				T/N		0.066 ~0.121 (0.081)			
				S/N					
0.125 (0.125)				1W		0.085 ~0.116 (0.090)			
0.118 ~0.340 (0.139)				2W		0.118 (0.118)			
				3W					
		0.08-0.12	-	1M		0.065 ~0.630 (0.140)		有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12	▲0.050~▲0.045	3M					
		-	-	6M					
		-	-	1Y					

◀ オペ情報、入札結果 ▶

国短買入 10,000億円 12/2 応札 24,131億円 落札 10,000億円 全取利回り較差 0.012% 平均利回り較差 0.012%

2年利付国債(表面利率0.1%) 応札1兆6,966億円落札2兆5,092億円(I 非競争入札:1,902億円) 12/15~2016/12/15 0.009%按分81.2487%平均0.005%

成長基盤強化(本則第18回) 12/5~2018/12/3 (1,459日間) 貸付予定額11,530億円 貸付利率0.10% 貸付先数 79先

成長基盤強化(本則第14回の借り換え) 12/5~2015/12/4 (364日間) 貸付予定額 1,709億円 貸付利率0.10% 貸付先数 65先

成長基盤強化(本則第10回の借り換え) 12/5~2015/12/4 (364日間) 貸付予定額 1,270億円 貸付利率0.10% 貸付先数 57先

成長基盤強化(本則第6回の借り換え) 12/5~2015/12/4 (364日間) 貸付予定額 968億円 貸付利率0.10% 貸付先数 54先

成長基盤強化(ABL等特則第14期) 12/5~2018/12/4 (1,460日間) 貸付予定額 186億円 貸付利率0.10% 貸付先数 10先

成長基盤強化(ABL等特則第6期の借り換え) 12/5~2016/12/5 (731日間) 貸付予定額 64億円 貸付利率0.10% 貸付先数 5先

成長基盤強化(小口特則第11期) 12/5~2018/12/3 (1,459日間) 貸付予定額 8.63億円 貸付利率0.10% 貸付先数 21先

成長基盤強化(小口特則第7期の借り換え) 12/5~2015/12/4 (364日間) 貸付予定額 3.50億円 貸付利率0.10% 貸付先数 13先

成長基盤強化(小口特則第3期の借り換え) 12/5~2015/12/4 (364日間) 貸付予定額 6.53億円 貸付利率0.10% 貸付先数 9先

成長基盤強化(米ドル特則第10期) 12/5~2015/12/4 (364日間) 貸付予定額 172百万ドル 貸付先数 13先

成長基盤強化(米ドル特則第6期の借り換え) 12/5~2015/12/4 (364日間) 貸付予定額 760百万ドル 貸付先数 21先

成長基盤強化(米ドル特則第2期の借り換え) 12/5~2015/12/4 (364日間) 貸付予定額 1,461百万ドル 貸付先数 13先

「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