

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/11/13(金) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	13日需給速報		16日需給予想		17日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	1,100		0	
財政		3,300	▲ 18,900	▲ 1,000		
資金過不足		2,900	▲ 17,800	▲ 1,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			1,100			
64,884			▲ 1,200			
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入					15,000	
国庫短期証売却						
国債買入		12,100			7,800	
CP等買入						
		▲ 900	▲ 300			
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028						
被災地支援						
3,161						
社債等買入				800		
ETF買入		200		100		
国債補完供給						
小計		11,400	500	22,800		
当預増減		14,300	▲ 17,300	21,800		

<< 11/16の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,471,800	前日比	▲ 17,300
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.07~0.08%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

<< 13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186兆4,000億円(当座預金残高見込みは249兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態を中心に0.076~0.078%近辺の調達希望で始まったが、大手行の0.077~0.079%の調達希望後は取り上がり、立ち上がりは0.077~0.079%の出合い。大手行の調達が終了した一巡後は0.075%近辺まで低下し本日の取引を終えた。ターム物は閑散とした取引であった。

<< 13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。短国市場は短国買入オペが15,000億円でおファーされ、平均利回較差こそ+0.005%となったが、レートの低い6M物で売却が進んでいると見られることや、市場の品薄感を反映し、按分利回較差は▲0.005%となった。オペ後は3Mゾーンで強含みの気配となり、3M物で▲0.036~▲0.035%の出合いが見られた。CP市場は発行・償還共に少なく、極めて閑散なマーケットだった。発行レートは横ばいであった。

<< 16日の材料 >>
 *7-9月期のGDP1次速報(市場予想:前期比年率▲0.2%)
 *10月のユーロ圏消費者物価指数改定値

<<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	0.07684%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07700%	有担 0.03100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.300	▲ 0.005	19,596.91	▲ 100.86	122.58-60	122.67-69

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	11/6	11/9	11/10	11/11	11/12	11/13
日銀当預残	2,484,500	2,455,500	2,447,600	2,477,500	2,474,800	2,489,100
準備預金残	2,256,500	2,236,800	2,224,200	2,254,400	2,254,400	2,268,100
レート	0.077%	0.078%	0.077%	0.078%	0.078%	0.078%
月中平均	0.07738%	0.07744%	0.07740%	0.07745%	0.07750%	0.07760%

当座預金残高	2,489,100	11/13以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	2,268,100	11/16以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,861,100	積数	1,964,600
超過準備	1,861,100	1日平均	65,500
非準備先残高	221,000	積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)	2,025,300
11月の新所要見込		65,500 (一日平均)	

11/12のマナタリーベース		3,442,800	
11/12コール合計	225,270	無担 90,551	有担 134,719
コール前日増減	計 ▲ 192	無担 ▲ 94	有担 ▲ 98

11/13の加重平均レート(速報)				11/12の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)	0.065 ~ 0.125 (0.078)	有担(平均)	0.030 ~ 0.040 (0.031)	CP気配a-1	短国	O/N	0.060 ~ 0.125 (0.078)	無担先日付分	0.030 ~ 0.040 (0.031)
	0.073 ~ 0.125 (0.086)					T/N		0.073 ~ 0.121 (0.080)	
						S/N			
	0.099 (0.099)					1W		0.130 (0.130)	
	0.077 (0.077)					2W		0.160 (0.160)	
						3W			
						1M		0.075 ~ 0.165 (0.137)	有担先日付分
	0.175 (0.175)					2M			
	0.085 (0.085)					3M			
						6M			
						1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	15,000億円	11/17	応札	25,666億円	落札	15,001億円	按分利回り較差	-0.005%	28.7%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	11/17	応札	12,210億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	-0.005%	97.6%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	2,400億円	11/17	応札	6,173億円	落札	2,404億円	按分利回り較差	-0.013%	65.8%	平均利回り較差	-0.008%
国債買入	1,400億円	11/17	応札	3,755億円	落札	1,408億円	按分利回り較差	0.000%	66.9%	平均利回り較差	0.001%
ETF買入	362億円	約定日 11/13									

「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