

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/11/26(木) <<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		30日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,600	▲ 2,000			1,100
財政		700	▲ 15,300			7,000
資金過不足		▲ 1,900	▲ 17,300			8,100
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						1,300
64,865						▲ 1,600
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		11,100				7,800
CP等買入						4,500
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						
ETF買入		100		200		
国債補完供給						
小計		10,900	▲ 500			12,000
当預増減		9,000	▲ 17,800			20,100

<< 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	2,440,500	前日比	▲ 17,800
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%台後半での出合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1,000億円増の183兆6,000億円(当座預金残高見込みは245兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.076~0.078%、大手行からは0.075%での調達で始まった。一巡後は、0.07~0.075%で散発的な出合いが見られるなか本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態の調達が見られた。

<< 26日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは前日から横ばい圏で推移した。短国市場は3M物の入札が実施された。オペ減額の影響により過去最低水準となった前回(按分▲0.0357%、平均▲0.0391%)からのレート上昇が期待されていたものの、WI取引において▲0.10%でまとまった出合いがみられ、按分落札利回りは前回と同水準である▲0.0353%(按分比率10.1132%)、平均落札利回りは過去最低利回りを大きく更新する▲0.0863%と非常に強い決着となった。平均と按分が大きく乖離したため、セカンダリーは▲0.06~▲0.04%で推移した。CP市場は、月末発行となり建設、ノンバンク、石油、機械等の幅広い業態からまとまった発行があり、発行総額は1兆1,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは前日のオペの影響も含め、投資家の需要が強く、高格付け銘柄を中心に弱含み横ばいで推移した。

<< 27日の材料 >>

- *10月の完全失業率(市場予想: 3.4%)
- *10月の有効求人倍率(市場予想: 1.24倍)
- *10月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比+0.1%)
- *10月全国・11月都区部消費者物価指数(CPI)
- 市場予想: 全 国(10月)前年同月比(除く生鮮): ▲0.1%
- 市場予想: 東京都区部(11月)前年同月比(除く生鮮): ▲0.1%
- *基調的なインフレ率を捕捉するための指標(速報)
- *英国7-9月期のGDP改定値
- *2年利付国債入札(25,000億円、12/15発行)

当座預金残高	2,458,300	11/26以降の残り所要積立額	28,000
準備預金残高	2,241,800	11/27以降の残り所要積立額	19,400
積み終了先	1,827,900	積数	1,000
超過準備	1,826,900	1日平均	1,000
非準備先残高	216,500		
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)	1,964,600		
準備預金進捗率	99.01% (実績)	36.67% (日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	122.68-70
0.295 ▲ 0.005	19,944.41 96.83	為替(5時)	122.63-64

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	11/24	11/25	11/26
日銀当預残	2,490,900	2,462,700	2,457,900	2,451,700	2,449,300	2,458,300
準備預金残	2,266,900	2,235,800	2,239,700	2,234,200	2,231,600	2,241,800
レート	0.084%	0.078%	0.077%	0.078%	0.078%	0.076%
月中平均	0.07800%	0.07800%	0.07783%	0.07783%	0.07784%	0.07777%

11/25のマナターベース				3,422,800		
11/25コール	合計	204,010	無担	65,336	有担	138,674
コール前日増減	計	▲ 3,554	無担	▲ 4,287	有担	733

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	O/N	無担当日分		有担当日分	
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)								0.060 ~0.125 (0.078)	
0.073 ~0.130 (0.087)						T/N		0.073 ~0.121 (0.082)		
						S/N				
0.130 (0.130)						1W		0.117 ~0.130 (0.126)		
						2W		0.117 ~0.310 (0.172)		
						3W		0.115 (0.115)		
0.200 (0.200)				0.07-0.12	-	1M				有担先日付分
				0.07-0.11	-	2M				
				0.07-0.11	▲0.10-▲0.04	3M				
				-	-	6M		0.117 (0.117)		
				-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	11/30	~ 2/29 (91日間) 応札	1,310億円	落札	1,310億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債買入	4,000億円	11/30	応札	11,767億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.003%	84.6%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	2,400億円	11/30	応札	6,651億円	落札	2,412億円	按分利回り較差	-0.005%	34.8%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	1,400億円	11/30	応札	4,281億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	-0.005%	53.0%	平均利回り較差	-0.002%

T-Bill3M 応札1兆2,299億円 落札4兆3,620億7,000万円(非競争入札:4,179億円) 11/30~2016/3/7 ▲0.0353% 按分10.1132% 平均▲0.0863%

「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