

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/11/30(月) <<セントラル短資株式会社>>

## 資金需給

単位 億円

	30日需給速報		1日需給予想 金額	2日当社予想 金額
	即日	金額		
銀行券		▲ 100	▲ 500	▲ 1,000
財政		10,100	▲ 13,500	▲ 55,000
資金過不足		10,000	▲ 14,000	▲ 56,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,300		
64,615		▲ 1,600		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			2,500	
国庫短期証売却				
国債買入		8,200		10,800
CP等買入		4,500		
		▲ 3,500	▲ 100	
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				
国債補完供給 即日		▲ 200	200	
小計		8,700	2,600	10,800
当預増減		18,700	▲ 11,400	▲ 45,200

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	2,447,200	前日比	▲ 11,400
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。

### 30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、前営業日比2兆7,000億円増の184兆6,000億円(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0.075~0.078%、大手行からは0.075%での調達希望で始まった。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、目立った出合いが見られなかった。

### 30日のオープン市場動向

現先S/N物は低位横ばい圏で推移。短国市場は動意に乏しく閑散。3M物で▲0.055%の少額出合いが見られた程度にとどまった。CP市場は、石油業態から大型の発行案件が見られたものの、発行総額は500億円程度にとどまった。発行レートは引き続き低位横ばい圏で推移。一部の年越え物では買い進まれる動きが見られた。

### 1日の材料

- \*7-9月期の法人企業統計調査季報
- \*米国11月のISM製造業景況指数
- \*米国10月の建設支出
- \*10年利付国債入札(24,000億円、12/21発行)

### 11月の加重平均レート

(土日を含む)	無担	0.07763%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07811%	有担	0.03100%

当座預金残高	2,458,600	11/30以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,249,100		10,100
積み終了先	1,843,200	12/1以降の残り所要積立額	
超過準備	1,843,200	積数	7,300
非準備先残高	209,500	1日平均	500
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)			1,961,300
準備預金進捗率	99.63% (実績)		50.00% (日数)

JGB新発10年債	0.300	0.000	日経平均株価(終値)	19,747.47	▲ 136.47	為替(9時)	122.83-84
						為替(5時)	122.82-84

### 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	11/24	11/25	11/26	11/27	11/30
日銀当預残	2,457,900	2,451,700	2,449,300	2,458,300	2,439,900	2,458,600
準備預金残	2,239,700	2,234,200	2,231,600	2,241,800	2,222,300	2,249,100
レート	0.077%	0.078%	0.078%	0.076%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07783%	0.07783%	0.07784%	0.07777%	0.07769%	0.07763%

11/27のマナリーベース		3,418,000	
11/27コール 合計	202,200	無担	63,182
有担	139,018		
コール前日増減 計	▲ 2,604	無担	▲ 1,392
有担	▲ 1,212		

11/30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		有担当日分	
0.060 ~0.080 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)					O/N	0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.074 ~0.125 (0.081)						T/N		0.074 ~0.130 (0.091)	
						S/N			
0.081 ~0.117 (0.100)						1W		0.100 (0.100)	
0.340 (0.340)						2W		0.118 (0.118)	
						3W			
				0.07-0.12	-	1M			有担先日付分
				0.07-0.11	-	2M			
				0.07-0.11	▲0.055	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

## オペ情報、入札結果

国債補完	4,000億円	11/30	~ 12/1 (1日間) 応札	199億円	落札	199億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	3,000億円	12/2	応札	9,151億円	落札	3,003億円	0.004%	90.0%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	12/2	応札	13,202億円	落札	4,006億円	0.003%	20.3%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	2,400億円	12/2	応札	7,298億円	落札	2,410億円	0.007%	27.9%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	1,400億円	12/2	応札	4,930億円	落札	1,406億円	0.005%	8.1%	平均利回り較差	0.008%

ETF買入 362億円 約定日 11/30

- 成長基盤強化(本則第22回) 12/4~2019/12/4 (1,461日間) 貸付予定総額 9,345億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 59先
- 成長基盤強化(本則第14回の借り換え) 12/4~2016/12/2 (364日間) 貸付予定総額 982億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 53先
- 成長基盤強化(本則第10回の借り換え) 12/4~2016/12/2 (364日間) 貸付予定総額 635億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 41先
- 成長基盤強化(出資等特則第18期) 12/4~2019/12/4 (1,461日間) 貸付予定総額 9億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 3先
- 成長基盤強化(出資等特則第10期の借り換え) 12/4~2017/12/4 (731日間) 貸付予定総額 9億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 3先
- 成長基盤強化(小口特則第15期) 12/4~2019/12/4 (1,461日間) 貸付予定総額 9.42億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 17先
- 成長基盤強化(小口特則第7期の借り換え) 12/4~2016/12/2 (364日間) 貸付予定総額 2.49億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 8先
- 成長基盤強化(小口特則第3期の借り換え) 12/4~2016/12/2 (364日間) 貸付予定総額 5.35億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 5先
- 成長基盤強化(米ドル特則第14期) 12/4~2016/12/2 (364日間) 貸付予定総額 20百万ドル 貸付先数 16先
- 成長基盤強化(米ドル特則第10期の借り換え) 12/4~2016/12/2 (364日間) 貸付予定総額 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) 12/4~2016/12/2 (364日間) 貸付予定総額 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) 12/4~2016/12/2 (364日間) 貸付予定総額 1,453百万ドル 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