

2014/11/4(火) <セントラル短資株式会社>

<<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想		6日当社予想	
	即日	金額		金額		金額
銀行券		800		1,300		0
財政		▲ 20,500		5,100		▲ 2,000
資金過不足		▲ 19,700		6,400		▲ 2,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		1,600		4,900		
87,160		▲ 2,900		▲ 10,100		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						22,500
国庫短期証売却						
国債買入						14,600
CP等買入						
		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053						
被災地支援						
3,255						
社債等買入						
ETF買入						
国債補充供給		200				
小計		▲ 1,300		▲ 5,400		37,100
当預増減		▲ 21,000		1,000		35,100

当座預金残高	1,656,000	11/4以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,517,000		19,400
積み終了先	1,248,800	11/5以降の残り所要積立額	
超過準備	1,248,700	積数	17,600
非準備先残高	139,000	1日平均	1,600
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			1,921,100
準備預金進捗率	99.08%	(実績)	64.52% (日数)

10/31のマネタリーベース	2,595,500
10/31コール合計	175,943 無担 71,121 有担 104,822
コール前日増減	計 ▲ 3,427 無担 ▲ 3,963 有担 536

11/4 の加重平均レート(速報)				10/31 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	
0.045 ~0.135 (0.061)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.045 ~0.125 (0.060)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.057 ~0.120 (0.080)				T/N		0.056 ~0.123 (0.065)		
				S/N				
0.117 (0.117)				1W		0.055 ~0.400 (0.129)		
0.117 ~0.330 (0.144)				2W		0.250 (0.250)		
0.117 ~0.118 (0.117)				3W				
0.090 ~0.120 (0.111)		0.08-0.12	-	1M		0.150 (0.150)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.005-0.003	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	22,500億円	11/6	応札	43,042億円	落札	22,500億円	全取利回り較差	0.022%		平均利回り較差	0.023%
国債買入	5,500億円	11/6	応札	17,782億円	落札	5,500億円	按分利回り較差	-0.010%	94.5%	平均利回り較差	-0.010%
国債買入	5,500億円	11/6	応札	16,943億円	落札	5,503億円	按分利回り較差	-0.017%	79.8%	平均利回り較差	-0.015%
国債買入	2,400億円	11/6	応札	6,073億円	落札	2,400億円	全取利回り較差	-0.059%		平均利回り較差	-0.053%
国債買入	1,200億円	11/6	応札	4,766億円	落札	1,201億円	按分利回り較差	-0.174%	52.7%	平均利回り較差	-0.161%
米ドル資金供給(固定金利方式)			11/6~11/20 (14日間)		応札なし		貸付利率 0.580%				

「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

11/5の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,657,000	前日比	1,000
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12
無担O/Nは0.055~0.06%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

<<4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2兆6,000億円減少の124兆9,000億円(当座預金残高見込みは165兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.057~0.058%、大手行から0.05~0.055%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.057~0.058%近辺となった。一巡後は0.055~0.058%近辺での出合い。午後の取引は調整程度で一日の取引を終えた。ターム物については、出合いは閑散であった。

<<4日のオープン市場動向>>

短国現先レートS/Nは短国買入オペの影響から前日比でやや低下した。短国アウトライト市場は、3Mが▲0.005~0.003%の出合い。短国買入オペは22,500億円通知された。今後のオペ実施に対する不透明感からか、応札総額43,042億円、全取レート0.022%、平均レート0.023%と甘めの落札結果となった。CP市場は発行案件が少なく、償還総額500億円程度に対して発行総額200億円程度であった。発行レートは特段目立った動きもなく概ね横ばい圏での動きとなっていた。

<<5日の材料>>

*黒田日銀総裁、きさらぎ会にて講演

*9月の毎月勤労統計調査速報

*10月のマネタリーベース *11月の日銀当座預金増減要因見込み

*MPC(英中銀金融政策委員会、1日目) *米国10月のISM非製造業景況指数

*国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、11/10発行)

*10年利付国債入札(24,000億円、11/7発行)

*交付税特別会計借入(10,500億円、11/13借入)

<<コール10月の加重平均レート>>

(土日を含む)	無担	0.05929%	有担	0.03035%
(営業日のみ)	無担	0.05900%	有担	0.03055%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	113.70-72
0.440 ▲0.015	16,862.47 448.71	為替(5時)	113.57-59

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	10/27	10/28	10/29	10/30	10/31	11/4
日銀当預残	1,641,000	1,673,100	1,674,200	1,672,600	1,677,000	1,656,000
準備預金残	1,501,700	1,532,600	1,527,000	1,528,500	1,540,700	1,517,000
レート	0.059%	0.059%	0.059%	0.059%	0.060%	0.061%
月中平均	0.05930%	0.05929%	0.05928%	0.05927%	0.05929%	0.06025%