# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/11/12(水)　≪セントラル短資株式会社≫

## ≪資金需給≫

単位 億円

| | 12日需給速報 | | 13日需給予想 | 14日当社予想 |
|---|---|---|---|---|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | 600 | ▲ 200 | 0 |
| 財政 | | ▲ 1,100 | ▲ 4,900 | 2,000 |
| 資金過不足 | | ▲ 500 | ▲ 5,100 | 2,000 |
| 貸出 | | | | |
| 売出手形 0 | | | | |
| 本店共通 0 | | | | |
| 全店共通 0 | | | | |
| 共通(固定) 82,820 | | | | |
| 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 | | 15,200 | | 7,600 |
| CP等買入 | | 4,000<br>▲ 400 | ▲ 100 | |
| 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 | | | ▲ 100 | |
| ETF買入 | | | 100 | |
| 国債補完供給 | | | | |
| 小計 | | 18,800 | ▲ 100 | 7,600 |
| 当預増減 | | 18,300 | ▲ 5,200 | 9,600 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 当座預金残高 | 1,699,100 | 11/12以降の残り所要積立額 | |
| 準備預金残高 | 1,545,700 | | 1,500 |
| 積み終了先 | 1,284,900 | 11/13以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 1,284,900 | 積数 | 700 |
| 非準預先残高 | 153,400 | 1日平均 | 200 |
| 積み期間(10/16～11/15)の所要準備額(積数) | | | 1,929,200 |

**準備預金進捗率　99.96%　(実績)　90.32%　(日数)**

| 11/11のマネタリーベース | | | | | | 2,594,900 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 11/11コール | 合計 | 182,421 | 無担 | 72,633 | 有担 | 109,788 |
| コール前日増減 | 計 | ▲ 7,713 | 無担 | ▲ 7,524 | 有担 | ▲ 189 |

## ≪ 11/13の日銀調節とレート予想 ≫

| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 1,693,900 | 前日比 | ▲ 5,200 |
|---|---|---|---|---|---|
| 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。

### ≪ 12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1兆2,000億円増加の129兆4,000億円(当座預金残高見込みは169兆9,000億円)。無担O/Nは、地銀･信託業態から0.059～0.06%、大手行から0.055%での調達希望で立ち上がり、出合いの中心レートは0.059～0.060%近辺となった。一巡後は0.055～0.056%を中心とした出合いで推移しつつ、本日の取引を終了した。ターム物に関しては、ロール案件中心の取引となった。

### ≪ 12日のオープン市場動向 ≫

現先レートは低位横ばいでの推移となった。短国市場は動意に乏しく閑散な中、3M▲0.010%、6M0.000%で少額の出合いが見られた程度にとどまった。ＣＰ市場は15日にかかる発行となったことで、機械、鉄鋼業態でまとまった発行が見られ、発行総額は1,500億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいでの推移となった。

### ≪ 13日の材料 ≫

*9月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲1.9%)
*9月の石油等消費動態統計　*10月の企業物価指数
*米国10月の財政収支
*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、11/17発行)
*5年利付国債入札(27,000億円、11/17発行)

| JGB新発10年債 | | 日経平均株価(終値) | | 為替(9時) | 115.73-76 |
|---|---|---|---|---|---|
| 0.525 | 0.035 | 17,197.05 | 72.94 | 為替(5時) | 115.26-28 |

### 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 | 11/5 | 11/6 | 11/7 | 11/10 | 11/11 | 11/12 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 日銀当預残 | 1,656,700 | 1,695,100 | 1,675,400 | 1,655,700 | 1,680,800 | 1,699,100 |
| 準備預金残 | 1,518,900 | 1,549,300 | 1,541,800 | 1,515,700 | 1,538,000 | 1,545,700 |
| レート | 0.061% | 0.061% | 0.062% | 0.068% | 0.068% | 0.065% |
| 月中平均 | 0.06040% | 0.06050% | 0.06100% | 0.06170% | 0.06227% | 0.06250% |

### 11/12 の加重平均レート(速報)

| 無担(平均) | 有担(平均) | CP気配a-1 | 短国 |
|---|---|---|---|
| 0.045　～0.135　(0.065) | 0.030　～0.040　(0.031) | | |
| 0.060　～0.120　(0.065) | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| 0.075　(0.075) | | | |
| | | 0.08-0.12 | － |
| | | 0.08-0.12 | － |
| | | 0.08-0.12 | ▲0.010 |
| | | － | 0.0000 |
| | | － | － |

### 11/11 の加重平均レート(確報)　単位(%)

| | 無担当日分 | 無担先日付分 | 有担当日分 |
|---|---|---|---|
| O/N | 0.045　～0.135　(0.068) | | 0.030　～0.040　(0.031) |
| T/N | | 0.058　～0.120　(0.068) | |
| S/N | | | |
| 1W | | | |
| 2W | | 0.250　(0.250) | |
| 3W | | | |
| 1M | | | 有担先日付分 |
| 2M | | | |
| 3M | | | |
| 6M | | | |
| 1Y | | | |

## ≪オペ情報、入札結果≫

| | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国債補完 | 1,536億円 | 11/12 | ～ | 11/13 | (1日間) | 応札 | 25億円 | 落札 | 25億円 | -0.400% | 全 取 | 平 均　-0.400%　(即) |
| 国債買入 | 4,000億円 | 11/14 | 応札 | 9,009億円 | 落札 | 4,001億円 | 按分利回り較差 | 0.024% | 76.2% | 平均利回り較差 | 0.029% | |
| 国債買入 | 2,400億円 | 11/14 | 応札 | 3,777億円 | 落札 | 2,401億円 | 按分利回り較差 | 0.035% | 20.5% | 平均利回り較差 | 0.043% | |
| 国債買入 | 1,200億円 | 11/14 | 応札 | 3,121億円 | 落札 | 1,200億円 | 按分利回り較差 | 0.022% | 46.7% | 平均利回り較差 | 0.031% | |
| 社債買入 | 1,000億円 | 11/18 | 応札 | 1,046億円 | 落札 | 1,000億円 | 按分レート | 0.048% | 81.1% | 平均落札レート | 0.091% | |

「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