

2015/11/16(月)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	16日需給速報 即日 金額	17日需給予想 金額	18日当社予想 金額
銀行券	1,000	200	▲ 1,000
財政	▲ 21,200	1,600	1,000
資金過不足	▲ 20,200	1,800	0
貸出			
売出手形 0			
本店共通 0			
全店共通 0			
共通(固定) 64,785	▲ 1,100		
国債買現 0	▲ 1,200		
CP買現 0			
国庫短期証買入		15,000	
国庫短期証売却			
国債買入		8,100	900
CP等買入			
	▲ 300	▲ 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	800		
ETF買入	100		
国債補完供給			
小計	500	23,000	900
当増増減	▲ 19,700	24,800	900

当座預金残高	2,469,400	11/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,248,100		1,964,600
積み終了先	668,600	11/17以降の残り所要積立額	
超過準備	495,200	積数	616.900
非準備先残高	221,300	1日平均	21,300
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	68.60%	(実績)	3.33% (日数)

11/13のマネタリーベース	3,457,400
11/13コール 合計	218,487 無担 83,273 有担 135,214
コール前日増減 計	▲ 6,783 無担 ▲ 7,278 有担 495

11/16 の加重平均レート(速報)				11/13 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		
0.060 ～0.125 (0.078)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N 0.065 ～0.125 (0.078)		0.030 ～0.040 (0.031)		
0.073 ～0.125 (0.079)				T/N	0.073 ～0.125 (0.086)			
				S/N				
				1W	0.099 (0.099)			
0.145 ～0.340 (0.161)				2W	0.077 (0.077)			
				3W				
		0.07-0.12	-	1M		有担先日付分		
		0.07-0.11	-	2M	0.175 (0.175)			
		0.07-0.11	-	3M	0.085 (0.085)			
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完	4,000億円	11/16	～ 11/17 (1日間)	応札	37億円	落札	37億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	700億円	11/18	応札	3,913億円	落札	700億円	按分利回り較差	0.005%	69.7%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	200億円	11/18	応札	821億円	落札	200億円	按分価格較差	-0.120円	8.0%	平均価格較差	-0.281円
CP買入	3,500億円	11/19	応札	6,051億円	落札	3,500億円	按分レート	0.051%	5.0%	平均落札レート	0.066%
ETF買入	362億円	約定日 11/16									
J-REIT買入	15億円	約定日 11/16									

「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

《 11/17の日銀調節とレート予想 》

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,494,200	前日比	24,800
O/N	0.07～0.08	T/N	0.07～0.12	S/N	0.07～0.12

無担O/Nは0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。

《 16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1兆5,000億円減の184兆9,000億円(当座預金残高見込みは247兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.075～0.078%での調達、大手行からは0.075%での調達希望で始まった。一巡後は調達レートがやや低下し、0.07～0.075%での出合いが散見されるなか本日の取引を終えた。また、本日も一部邦銀から0.125%での試し取りが行われた。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が複数見られた。

《 16日のオープン市場動向 》

短国現先レートS/Nは前日から横ばい圏。短国アウトライト市場は特段の出合いも無く、様子見姿勢が強かった。CP市場は償還総額900億円程度に対し、一部大型の発行案件等があり、発行総額は1,000億円程度だった。引き続き運用意欲が強く、発行レートは低位横ばいの印象であった。CP等買入オペが3,500億円度でオファーされ、平均落札利回0.066%、按分落札利回0.051%と前回よりもレートが低下した。

《 17日の材料 》

*米国10月の消費者物価指数

*米国10月の鉱工業生産・設備稼働率

*英国10月の消費者物価指数

*国庫短期証券入札(1年、25,000億円、11/20発行)

*5年利付国債入札(25,000億円、11/19発行)

*預金保険機構借入(12ヶ月程度、11/27借入)

《 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)	122.30-31
0.300 0.000	19,393.69 ▲ 203.22	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	11/9	11/10	11/11	11/12	11/13	11/16
日銀当預残	2,455,500	2,447,600	2,477,500	2,474,800	2,489,100	2,469,400
準備預金残	2,236,800	2,224,200	2,254,400	2,254,400	2,268,100	2,248,100
レート	0.078%	0.077%	0.078%	0.078%	0.078%	0.078%
月中平均	0.07744%	0.07740%	0.07745%	0.07750%	0.07760%	0.07763%