

2015/11/20(金) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	20日需給速報	24日需給予想	25日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 2,100	▲ 400	▲ 1,000
財政	▲ 14,200	▲ 2,200	▲ 2,000
資金過不足	▲ 16,300	▲ 2,600	▲ 3,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)		2,800	
64,785		▲ 2,700	
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	12,100		
CP等買入			
	▲ 600	▲ 400	
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	▲ 100		
ETF買入	100	100	
国債補充供給			
小計	11,500	▲ 200	2,500
当預増減	▲ 4,800	▲ 2,800	▲ 500

当座預金残高	2,457,900	11/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,239,700		97,600
積み終了先	1,826,900	11/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,822,200	積数	46,600
非準預先残高	218,200	1日平均	2,100
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	97.63%	(実績)	26.67% (日数)

11/19のマネタリーベース	3,432,700
11/19コール合計	194,634 無担 57,279 有担 137,355
コール前日増減	計 ▲ 5,251 無担 ▲ 7,442 有担 2,191

11/20 の加重平均レート(速報)				11/19 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	有担当当日分		
0.065 ~0.080 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.125 (0.078)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.073 ~0.121 (0.082)				T/N	0.073 ~0.121 (0.082)			
				S/N				
				1W	0.117 ~0.118 (0.117)			
				2W	0.120 ~0.150 (0.131)			
				3W				
		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.15-▲0.09	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.13-▲0.08	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入 2,500億円 11/25 応札 12,070億円 落札 2,500億円 按分利回り較差 0.030% 54.3% 平均利回り較差 0.048%

被災地支援(第55回) 11/27～2016/11/25 (364日間) 貸付予定総額 0億円 貸付利率 0.10%

流動性供給 応札 1兆7,972億円 4,988億円 11/25 募入最大利回り較差 ▲0.003% 按分 48.7268% 募入平均利回り較差 ▲0.005%

ETF買入 362億円 約定日 11/20

「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

<< 11/24の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,455,100	前日比	▲ 2,800
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。					

<< 20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3,000億円増の184兆円(当座預金残高見込みは246兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.075～0.078%での調達、大手行からは0.07%台前半での調達希望で始まった。一巡後は、0.075%前後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。

<< 20日のオープン市場動向 >>

短国現先レートS/Nは前日からほぼ変わらず。短国買入オペは前回より大幅減額の2,500億円で開催され、按分利回り較差+0.03%、平均利回り較差+0.048%、按分比率54.3%という結果だった。短国アウトライイト市場は、3M物が▲0.15～▲0.09%、1Y物が▲0.13～▲0.08%の出合いが見られた。後場にかけてやや売り物が目立っていた。CP市場は25日発行にあたって入札案件が多く、鉄鋼、通信、機械、ノンバンク等の業種から比較的多くまとまった発行が見られた。償還総額2,100億円程度に対して発行総額は2,600億円程度で、発行レートは引き続き低位横ばいとの印象だった。

<< 23日の材料 >>

*米国10月の中古住宅販売

<< 24日の材料 >>

*米国7-9月期のGDP改定値

*米国9月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数

*米国11月のCB消費者信頼感指数

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	122.90-91
0.310	0.015	為替(5時)	123.00-02

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	11/13	11/16	11/17	11/18	11/19	11/20
日銀当預残	2,489,100	2,469,400	2,493,000	2,490,900	2,462,700	2,457,900
準備預金残	2,268,100	2,248,400	2,267,500	2,266,900	2,235,800	2,239,700
レート	0.078%	0.078%	0.078%	0.084%	0.078%	0.077%
月中平均	0.07760%	0.07763%	0.07765%	0.07800%	0.07800%	0.07783%