

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/10/6(月) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	6日需給速報		7日需給予想	8日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,400	1,200	0
財政		▲ 40,900	2,700	1,000
資金過不足		▲ 39,500	3,900	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		3,300		
98,648		▲ 2,700		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			35,000	
国庫短期証売却				
国債買入			5,700	
CP等買入				
		▲ 300	▲ 500	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援 3,689				
社債等買入				
ETF買入		100	100	
国債補充供給				
小計		400	40,300	0
当増増減		▲ 39,100	44,200	1,000

当座預金残高	1,583,100	10/6以降の残り所要積立額	14,100
準備預金残高	1,456,100	10/7以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,205,300	積数	12,000
超過準備	1,205,300	1日平均	1,300
非準備先残高	127,000	積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,847,900
準備預金進捗率	99.35% (実績)		70.00% (日数)

10/3のマネタリーベース		2,533,000	
10/3コール	合計	171,303	無担 63,603 有担 107,700
コール前日増減	計	▲ 2,042	無担 504 有担 ▲ 2,546

10/6の加重平均レート(速報)				10/3の加重平均レート(確報)				単位 (%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.045 ~0.135 (0.060)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.045 ~0.135 (0.061)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.122 (0.071)					0.065 ~0.120 (0.068)			
0.062 ~0.400 (0.155)					0.330 (0.330)			
0.260 (0.260)								
0.250 (0.250)					0.143 (0.143)			
0.118 ~0.200 (0.132)		0.08-0.12	-		0.090 ~0.250 (0.134)		有担先日付分	
		0.08-0.12	-					
0.117 (0.117)		0.08-0.12	▲0.02					
		-	-					
		-	-					

<<オペ情報、入札結果>>

預保借入(金融再生勘定) 370億円 10/17~2015/10/16 応札 1,740億円 落札 370億円 0.095% 按分 100.000% 平均 0.095%

「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

<< 10/7の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,627,300	前日比	44,200
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは、0.06%近辺での出合いが中心になると見込まれる。

<< 6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、121兆4,000億円(当座預金残高見込みは158兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀・信託業態から0.05~0.058%、大手行からは0.05%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.058%となるなど、先週末よりもやや弱めの立ち上がりとなった。一巡後は調達レートはさほど低下せず、0.055%近辺での出合いが数件見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、本日もロール案件での出合いが散見される程度であった。

<< 6日のオープン市場動向 >>
現先レートS/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、取引閑散ながらも3M物で▲0.02%での出合いが少し見られた。CP市場は、鉄鋼・小売業態からまとまった金額の発行が実施されたものの、発行総額は約800億円程度と少なめであった。発行レートは、概ね先週末と同水準であった。

<< 7日の材料 >>
*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
*黒田日銀総裁定例会見
*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*8月の景気動向指数速報
*米国8月の消費者信用残高

<<コール9月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06710%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06640%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.515	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	15,890.35	182.30	為替(9時)	109.80-82
						為替(5時)	109.42-44

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	9/29	9/30	10/1	10/2	10/3	10/6
日銀当預残	1,600,800	1,615,200	1,620,300	1,608,200	1,622,200	1,583,100
準備預金残	1,477,400	1,492,800	1,492,000	1,477,400	1,498,000	1,456,100
レート	0.066%	0.029%	0.049%	0.056%	0.061%	0.060%
月中平均	0.06841%	0.06710%	0.04900%	0.05250%	0.05760%	0.05800%