

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/10/15(水) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	15日需給速報	16日需給予想	17日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	1,100	▲ 400	▲ 1,000
財政	42,000	1,800	▲ 6,000
資金過不足	43,100	1,400	▲ 7,000
貸出			
売出手形	0		
本店共通	0		
全店共通	0		
共通(固定)	97,428		
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		9,200	
CP等買入	3,600 ▲ 600	▲ 200	
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			
国債補完供給	200		
小計	3,200	44,000	0
当増減	46,300	45,400	▲ 7,000

当座預金残高	1,654,400	10/15以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,525,800		100
積み終了先	1,266,200	10/16以降の残り所要積立額	
超過準備	1,266,100	積数	1,920,500
非準備先残高	128,600	1日平均	62,000
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,856,300		

10月の新所要見込 62,000 (一日平均)

10/14のマナターベース		2,517,000	
10/14コール 合計	166,208 無担	57,666 有担	108,542
コール前日増減 計	825 無担	▲ 1,163 有担	1,988

10/15の加重平均レート(速報)			10/14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)			0.045 ~0.135 (0.060)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.060 ~0.120 (0.077)					0.060 ~0.120 (0.097)		
0.125 (0.125)							
0.117 ~0.155 (0.136)					0.075 ~0.150 (0.097)		
0.118 ~0.175 (0.120)					0.118 ~0.160 (0.143)		
0.118 (0.118)							
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-		0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.12	0.0100				
		0.08-0.12	▲0.015				
		-	▲0.005				
		-	▲0.008~0.00				

<<オペ情報、入札結果>>

社債買入 1,000億円 10/21 応札 1,792億円 落札 891億円 按分レート 0.113% 16.2% 平均落札レート 0.127%

米ドル資金供給(固定金利方式) 10/17~10/23 (6日間) 応札なし 貸付利率 0.580%

T-Bill1Y 応札15兆3,166億円 落札2兆3,237億8,000万円(非競争入札:1,762億円) 10/20~2015/10/20 0.0020% 按分22.7237% 平均0.0010%

30年利付国債(表面利率1.7%) 応札1兆6,538億円 落札6,397億円(I非競争入札:591億円) 10/17~2044/9/20 1.637% 按分23.2097% 平均1.633%

ETF買入 147億円 約定日 10/15

J-REIT買入 8億円 約定日 10/15

「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録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

<< 10/16の日銀調節とレート予想 >>				
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,699,800	前日比 45,400
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。

<< 15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、127兆円(当座預金残高見込みは165兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは信託業態から0.057~0.058%、地銀業態から0.056~0.057%、大手行からは0.055%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.058%と昨日と同水準での立ち上がりとなった。一巡後は0.056%近辺での出合いが散見される程度で、積み最終日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が2Wおよび1M物を0.118%で調達を行った。

<< 15日のオープン市場動向 >>
現先取引S/Nは引き続き底ばい圏で推移した。短国市場は1Y物の入札が実施された。結果は平均利回り0.001%按分利回り0.002%と、短国買入オペを意識してか強めの決着となった。セカンダリー市場では△0.008~△0.005%の出合いが少額見られた。CP発行市場は鉄鋼・石油業態などの案件があり、発行総額は1,200億円程度。レート水準は概ね横ばいであった。

<< 16日の材料 >>
*米国9月の鉱工業生産・設備稼働率
*ユーロ圏9月の消費者物価指数改定値
*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、10/20発行)
*交付税特別会計借入(10,500億円、10/24借入)

<<コール9月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06187%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06095%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.485	▲ 0.010
日経平均株価(終値)	15,073.52	137.01
為替(9時)	107.31-33	
為替(5時)	107.22-23	

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	10/7	10/8	10/9	10/10	10/14	10/15
日銀当預残	1,628,800	1,626,200	1,625,400	1,626,400	1,608,100	1,654,400
準備預金残	1,502,700	1,494,500	1,494,000	1,489,300	1,484,200	1,525,800
レート	0.059%	0.059%	0.059%	0.060%	0.060%	0.061%
月中平均	0.05814%	0.05825%	0.05833%	0.05885%	0.05893%	0.05907%