

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/10/21(火)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	21日需給速報		22日需給予想	23日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 1,100	▲ 2,000
財政		▲ 23,900	▲ 1,400	▲ 13,000
資金過不足		▲ 24,500	▲ 2,500	▲ 15,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
95,098				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		26,200		
国庫短期証売却				
国債買入			9,200	
CP等買入				3,500
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053		▲ 100	▲ 200	
被災地支援				
3,689				
社債等買入		900	▲ 100	
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		27,100	9,000	3,500
当預増減		2,600	6,500	▲ 11,500
当座預金残高	1,654,600	10/21以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,522,100	161,900		
積み終了先	1,214,900	10/22以降の残り所要積立額		
超過準備	1,212,200	積数		
非準預先残高	132,500	1日平均		
		4,900		
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)		1,920,500		
準備預金進捗率	93.59%	(実績)	19.35%	(日数)

10/20のマナタリーベース		2,561,500	
10/20コール 合計	180,903	無担	71,855
有担			109,048
コール前日増減	計	5,266	無担
有担			2,828
			有担
			2,438

10/21の加重平均レート(速報)				10/20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	O/N	無担当日分	無担先日付分
0.045 ~ 0.135 (0.060)	0.030	~ 0.040 (0.031)					0.045 ~ 0.135 (0.060)	0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.055 ~ 0.120 (0.067)								0.055 ~ 0.120 (0.074)
0.117 ~ 0.150 (0.130)							0.117 ~ 0.400 (0.136)	
0.117 ~ 0.330 (0.131)							0.118 ~ 0.255 (0.136)	
0.118 (0.118)				0.08-0.12	-		0.118 ~ 0.280 (0.121)	有担先日付分
				0.08-0.12	-			
				0.08-0.12	▲ 0.10-▲ 0.04			
				-	▲ 0.045			
				-	-			
				-	-			

《オペ情報、入札結果》

国債補完 6,000億円 10/21 ~ 10/22 (1日間) 応札 10億円 落札 10億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 10/23~10/30 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.590%

20年利付国債(表面利率1.4%) 応札3兆9,119億円 落札1兆899億円(I非競争入札:1,089億円) 10/23~2034/9/20 1.323% 按分12.7490% 平均1.318%

《 10/22の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,661,100	前日比	6,500
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。

《 21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6,000億円増加の124兆4,000億円(当座預金残高見込みは165兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.056~0.057%、大手行から0.05~0.055%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.056~0.057%となった。一巡後は、0.056%近辺での出合い。午後の取引は調整程度で一日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物を0.117%、2Wおよび1M物を0.118%で調達を行った。

《 21日のオープン市場動向 》

現先S/N物は低位横ばい圏での推移となった。短国市場は売り物が無く、超閑散な地合い。3M・6Mでマイナスの出合いが散見された程度であった。CP市場は石油・電機・鉄鋼業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は1,700億円程度まで膨らんだ。発行レートは一部の銘柄で小幅低下する動きが見られたが、概ね横ばい圏での取引となった。

《 22日の材料 》

- *9月の貿易統計
- *米国9月の消費者物価指数
- *交付税特別会計借入(10,500億円、10/30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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	106.90-91
0.480 ▲ 0.010	14,804.28 ▲ 306.95	為替(5時)	106.56-58

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	10/14	10/15	10/16	10/17	10/20	10/21
日銀当預残	1,608,100	1,654,400	1,699,800	1,696,100	1,652,000	1,654,600
準備預金残	1,484,200	1,525,800	1,554,000	1,560,700	1,508,600	1,522,100
レート	0.060%	0.061%	0.058%	0.059%	0.060%	0.060%
月中平均	0.05893%	0.05907%	0.05900%	0.05900%	0.05905%	0.05910%

「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