

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/9/24(木)

<<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想	28日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,800	1,000	1,000
財政		37,300	4,700	10,000
資金過不足		39,100	5,700	11,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,300		
62,701		▲ 1,100		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			10,000	
国庫短期証売却				
国債買入		8,000	8,200	7,800
CP等買入		▲ 1,000	▲ 1,900	
貸出支援基金(成長)		51,505		
(増加)		252,028		
被災地支援			1,000	
3,166			▲ 1,000	
社債等買入		▲ 100	▲ 100	
ETF買入		100		
国債補完供給				
小計		7,200	16,200	7,800
当預増減		46,300	21,900	18,800

  

当座預金残高	2,403,400	9/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,196,000		38,100
積み終了先	1,806,800	9/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,806,800	積数	29,700
非準備先残高	207,400	1日平均	1,400
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,952,800		
準備預金進捗率	98.48% (実績)	30.00%	(日数)

<< 9/25の日銀調節とレート予想 >>				
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,425,300	前日比
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N
				0.07~0.12

無担O/Nは0.07%台後半の出合いが中心になると予想される。

<< 24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1兆9,000億円増の181兆9,000億円(当座預金残高見込みは240兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託・系統・証券業態から0.073~0.078%での調達で始まった。一巡後も、同水準で散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件中心の取引であった。

<< 24日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは前日からやや上昇した。短国3M物の入札はW I 取引で▲0.04~▲0.03%の出合いがみられ、結果は按分落札利回り▲0.016%(按分比率59.9767%)、平均落札利回り▲0.0348%と強めの決着となった。セカンダリーは▲0.04~▲0.027%で推移した。その他では1Y物で▲0.095~▲0.09%、6M物で▲0.04~▲0.03%の出合いが散見された。CP市場は、石油・機械・ノンバンク業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は2,200億円程度まで膨らんだ。発行レートは低位横ばい圏での推移となった。

<< 25日の材料 >>  
 \*8月全国・9月都区部消費者物価指数(CPI)  
 市場予想：全 国(8月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.1%  
 東京都区部(9月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.2%  
 \*8月の企業向けサービス価格指数  
 \*月例経済報告  
 \*米国4-6月期のGDP確報値  
 \*流動性供給入札(5,000億円、9/29発行)

<< コール8月積み期間分の加重平均レート >>			
(土日を含む)	無担	0.07632%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07636%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.23-25
0.325 ▲ 0.005	17,571.83 ▲ 498.38	為替(5時)	119.93-95

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	9/14	9/15	9/16	9/17	9/18	9/24
日銀当預残	2,333,800	2,356,200	2,353,900	2,359,400	2,357,100	2,403,400
準備預金残	2,133,700	2,152,000	2,152,600	2,156,500	2,142,400	2,196,000
レート	0.076%	0.076%	0.091%	0.076%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07593%	0.07593%	0.07688%	0.07682%	0.07687%	0.07683%

9/18のマネタリーベース			
		3,323,400	
9/18コール	合計	201,923	無担 72,556 有担 129,367
コール前日増減	計	▲ 7,876	無担 ▲ 4,682 有担 ▲ 3,194

9/24の加重平均レート(速報)				9/18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	有担当日分	
0.060 ~0.080 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.030 ~0.080 (0.077)		0.050 ~0.125 (0.080)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.072 ~0.125 (0.090)				T/N				
				S/N				
0.120 ~0.125 (0.121)				1W	0.117	(0.117)		
				2W				
				3W				
0.075 ~0.200 (0.100)		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.04-▲0.027	3M		0.118	(0.118)	
		-	▲0.04-▲0.03	6M				
		-	▲0.095-▲0.09	1Y				

<< オペ情報、入札結果 >>									
国債補完	4,000億円	9/24 ~ 9/25 (1日間) 応札	4億円	落札	4億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債補完	1,163億円	9/24 ~ 9/25 (1日間) 応札	17億円	落札	17億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	9/28 応札	14,975億円	落札	4,007億円	-0.005%	69.5%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	2,400億円	9/28 応札	8,096億円	落札	2,409億円	-0.007%	74.6%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	1,400億円	9/28 応札	5,857億円	落札	1,405億円	-0.010%	18.3%	平均利回り較差	-0.008%

T-Bill3M 応札16兆415億円 落札4兆6,777億7,000万円(非競争入札:4,322億円) 9/28~12/28 ▲0.0160% 按分59.9767% 平均▲0.0348%  
 ETF買入 317億円 約定日 9/24

「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