

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/10/6(火) <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		1,000	400	▲ 1,000
財政		4,900	2,400	▲ 3,000
資金過不足		5,900	2,800	▲ 4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
62,401				
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		4,700	12,300	
CP等買入		▲ 700	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028				
被災地支援				
3,166				
社債等買入				
ETF買入		100	200	
国債補完供給				
小計		14,100	12,300	0
当増増減		20,000	15,100	▲ 4,000

<< 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	2,409,800	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0.075%前後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、前日比2兆4,000億円増の180兆7,000億円(当座預金残高見込みは239兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態を中心に0.075~0.076%近辺の調達希望で始まった。まとまった金額に対しては0.077~0.078%程度での出合いも一部でみられた。取り急ぐ動きはみられず、一巡後の出合いは昨日と同水準の0.07~0.075%前後を中心に推移し、本日の取引を終了した。ターム物については、取引閑散であった。

<< 6日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は低位横ばい圏で推移。短国市場は6M物の入札が実施された。W I取引で▲0.03~▲0.02%の出合いが見られたことを受け、平均落札利回▲0.0282%・按分落札利回▲0.0181%と、6M物として過去最低の結果を更新する強い結果となった。セカンダリー市場では、一時▲0.05%まで買い進まれた。CP市場は、一部に大型の発行案件が見られたものの発行総額は600億円程度にとどまった。発行レートは低位横ばい圏で推移。CP等買入オベが実施され、平均落札利回0.071%・按分落札利回0.064%と前回比で上昇した。

<< 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
 *8月の景気動向指数速報
 *9月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *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	0.07457%	有担 0.03090%
(営業日のみ)	無担	0.07337%	有担 0.03084%

当座預金残高	2,394,700	10/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,177,800		900
積み終了先	1,801,300	10/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,801,000	積数	500
非準備先残高	216,900	1日平均	100
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,952,600		
準備預金進捗率	99.97% (実績)	70.00% (日数)	

JGB新発10年債	0.320	0.010	日経平均株価(終値)	18,186.10	180.61	為替(9時)	120.46-48
						為替(5時)	120.16-18

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	10/5	10/6
日銀当預残	2,419,500	2,422,400	2,423,600	2,405,700	2,374,700	2,394,700
準備預金残	2,201,900	2,206,700	2,202,100	2,188,000	2,162,200	2,177,800
レート	0.076%	0.010%	0.076%	0.076%	0.077%	0.077%
月中平均	0.07679%	0.07457%	0.07600%	0.07600%	0.07620%	0.07633%

10/5のマネタリーベース				3,336,200	
10/5コール	合計	191,184	無担	60,224	有担
130,960					
コール前日増減	計	▲ 737	無担	▲ 364	有担
					▲ 373

10/6の加重平均レート(速報)				10/5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		有担当日分	
0.060 ~0.125 (0.077)	0.030	~0.040 (0.031)					O/N	0.060 ~0.125 (0.077)	
0.070 ~0.121 (0.079)					T/N		0.050 ~0.125 (0.079)		
					S/N				
0.117 (0.117)					1W		0.110 (0.110)		
0.170 (0.170)					2W		0.340 (0.340)		
					3W				
					1M				有担先日付分
					2M				
					3M				
					6M				
					1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,000億円	10/6 ~ 10/7 (1日間)	0億円	0億円	按分	平均	(即)
CP買入	4,000億円	10/9 応札	8,679億円	落札	4,000億円	按分レート	0.064%
						70.1%	平均落札レート
							0.071%
米ドル資金供給(固定金利方式)		10/8~10/16 (8日間)	応札 億ドル	落札 億ドル	貸付利率	0.630%	
T-Bill6M	応札13兆4,543億円	落札3兆1,987億8,000万円(非競争入札:3,012億円)	10/13~2016/4 11	▲0.0181%	按分3.8245%	平均▲0.0282%	
流動性供給	応札 8,763億円	落札 2,989億円	10/8 募入最大利回較差	0.009%	按分 36.1944%	募入平均利回較差	0.007%
交付税特会	1兆500億円	10/16~2016/4/15 応札 3兆440億円	落札 1兆500億円	0.075%	按分 95.0000%	平均	0.071%

「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