

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/1/9(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想		14日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		4,400	2,600	4,000		
財政		▲ 41,000	11,000	▲ 10,000		
資金過不足		▲ 36,600	13,600	▲ 6,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					2,100	
176,474					▲ 3,600	
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入			20,000			
国庫短期証売却						
国債買入			9,000			
CP等買入						
		▲ 300	▲ 600			
貸出支援基金 (成長) 34,599 (増加) 50,859 被災地支援 3,804						
社債等買入						
ETF買入		200	100			
国債補完供給		200				
小計		100	28,500	▲ 1,500		
当預増減		▲ 36,500	42,100	▲ 7,500		

<< 1/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,107,200	前日比	42,100
O/N	0.06~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07%前後の出合いが中心となるであろう。

<< 9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は、前日比2兆1,000億円減の83兆8,000億円(当座預金残高見込は106兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07%台前半での調達希望、大手行からは0.06%での調達希望と昨日同様の始まり。発行要因で大幅な不足日となった事から、本日もやや強めの展開となったものの、出合い一巡後は閑散のまま本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が数件みられた。

<< 9日のオープン市場動向 >>

現先レートは横ばいで推移。短国市場は3M物の入札が実施され、平均落札利回0.0612%、最高落札利回0.0628%と概ね事前予想通りの結果。セカンダリー市場は足元金利の高止まりから全般的に軟調地合いになっており、0.064%でまとまった出合いも見られた。CP市場は、電機、石油業態等によるまとまった額の発行も複数見られ、総額2,500億円程度の出合い。発行レートは概ね横ばいながらも、一部で若干のレート上昇も見られた。

<< 10日の材料 >>

- *11月の景気動向指数速報
- *12月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *ユーロ圏7-9月期GDP確報値
- *米国11月の卸売売上高
- *米国12月の雇用統計
- *国庫短期証券入札(6カ月、35,000億円、1/15発行)

<<コール12月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07313%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07370%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	104.83-85
0.700 ▲ 0.050	15,880.33 ▲ 241.12	為替(5時)	104.88-89

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	12/27	12/30	1/6	1/7	1/8	1/9
日銀当預残	1,063,600	1,070,800	1,096,900	1,108,100	1,101,600	1,065,100
準備預金残	960,900	969,600	986,000	998,200	990,800	970,300
レート	0.073%	0.068%	0.072%	0.071%	0.071%	0.073%
月中平均	0.07348%	0.07313%	0.06867%	0.06900%	0.06925%	0.06967%

当座預金残高	1,065,100	1/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	970,300		11,900
積み終了先	841,700	1/10以降の残り所要積立額	
超過準備	830,700	積数	10,500
非準預先残高	94,800	1日平均	1,800
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			1,871,800
準備預金進捗率	99.44% (実績)	80.65% (日数)	

1/8のマネタリーベース			
1/8コール	合計	182,070	無担 65,804 有担 116,266
コール前日増減	計	2,377	無担 1,945 有担 432

1/9の加重平均レート(速報)				1/8の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		CP配a-1	短国	無担当日分		有担当日分	
0.055 ~0.125 (0.073)	0.040	~0.050 (0.041)				O/N	0.060 ~0.085 (0.071)	0.040	~0.050 (0.041)
0.072 ~0.130 (0.104)						T/N		0.120	(0.120)
						S/N			
0.100 ~0.400 (0.138)						1W		0.117	~0.142 (0.119)
0.170 ~0.330 (0.216)						2W		0.118	~0.180 (0.122)
0.155 (0.155)						3W			
				0.07-0.13	0.06-0.075	1M		0.116	~0.118 (0.118)
				0.07-0.13	0.0550	2M			
				0.07-0.13	0.062-0.065	3M			
0.300 (0.300)				-	0.0530	6M			
				-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 1/14 ~ 4/9 (85日間) 応札 2,121億円 落札 2,121億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札27兆7,726億円 落札5兆2,152億8,000万円(非競争入札:4,846億円) 1/14~4/14 0.0628% 按分60.3963% 平均0.0612%
 10年物価連動国債(表面利率0.1%) 応札8,604億円 落札2,995億円 1/14~2023/9/10 ▲0.482% 按分 6.5934%
 ETF買入 128億円 約定日 1/9
 J-REIT買入 3億円 約定日 1/9

「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