

2014/10/7(火)

<<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,000	400	▲1,000
財政		4,400	▲2,600	1,000
資金過不足		5,400	▲2,200	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
98,648				
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		5,700		
CP等買入		▲500	▲700	
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		100	100	
国債補完供給				
小計		40,300	▲600	0
当預増減		45,700	▲2,800	0

当座預金残高	1,628,800	10/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,502,700		12,000
積み終了先	1,253,400	10/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,253,400	積数	10,000
非準備先残高	126,100	1日平均	1,300
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)			1,856,200
準備預金進捗率	99.46% (実績)		73.33% (日数)

10/6のマネタリーベース		2,492,500	
10/6コール合計	172,206	無担	61,788
有担		有担	110,418
コール前日増減	計	903	無担 ▲1,815
			有担 2,718

10/7の加重平均レート(速報)			10/6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	無担先日付分	有担当日分
0.045 ~0.135 (0.059)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.045 ~0.135 (0.060)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.055 ~0.120 (0.064)					0.065 ~0.122 (0.071)	
					0.062 ~0.400 (0.150)	
0.117 ~0.150 (0.139)					0.260 (0.260)	
0.330 (0.330)					0.250 (0.250)	
0.145 (0.145)					0.118 ~0.200 (0.132)	有担先日付分
0.118 ~0.250 (0.135)		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	▲0.02		0.117 (0.117)	
		-	-			
		-	-			
		-	-			
		-	-			
		-	-			

<<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 10/9~10/17 (8日間) 応札なし 貸付利率 0.590%

J-REIT買入 8億円 約定日 10/7

<<日銀金融政策決定会合・結果>>

- ・マネタリーベースが、年間約60~70兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(全員一致)
- ・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。
 - ①長期国債について、保有残高が年間約50兆円に相当するペースで増加し、平均残存期間が7年程度となるよう買入れを行う。
 - ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約1兆円、年間約300億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 - ③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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。」

<< 10/8の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,626,000	前日比	▲2,800
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。

<< 7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、125兆1,000億円(当座預金残高見込みは162兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀・信託業態から0.055~0.058%、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0.056~0.058%となった。一巡後は0.056~0.057%での出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、本日も目立った出合いは見られなかった。金融政策決定会合の結果が公表され、前回と同様、現状維持となった。また、今回は黒田総裁の国会出席で1998年9月以来となる会合の中断が発生した。

<< 7日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、低位で推移した。短国市場は品薄感が強く、3M物が▲0.02%で出合った程度で、取引閑散であった。CP市場は、電機・石油業態からまとまった発行が実施された。発行レートは、概ね横ばいとなっていた。

<< 8日の材料 >>
 *8月の国際収支 *9月の景気ウォッチャー調査
 *金融経済月報
 *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
 *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、10/10発行)
 *10年物価連動国債入札(5,000億円、10/10発行)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	108.88-90
0.510 ▲0.005	15,783.83 ▲107.12	為替(5時)	108.50-52

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	9/30	10/1	10/2	10/3	10/6	10/7
日銀当預残	1,615,200	1,620,300	1,608,200	1,622,200	1,583,100	1,628,800
準備預金残	1,492,800	1,492,000	1,477,400	1,498,000	1,456,100	1,502,700
レート	0.029%	0.049%	0.056%	0.061%	0.060%	0.059%
月中平均	0.06710%	0.04900%	0.05250%	0.05760%	0.05800%	0.05814%