

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/10/7(水)

《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		400	▲ 1,000	▲ 2,000
財政		2,200	▲ 2,400	1,000
資金過不足		2,600	▲ 3,400	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				3,400
62,401				▲ 700
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入		12,300		
CP等買入				4,000
		▲ 200	▲ 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		200	100	
国債補完供給	即日	▲ 500	500	
小計		11,800	400	6,700
当預増減		14,400	▲ 3,000	5,700

当座預金残高	2,409,100	10/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,188,200		500
積み終了先	1,807,400	10/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,807,400	積数	300
非準預先残高	220,900	1日平均	0
積み期間(9/16～10/15)の所要準備額(積数)			1,960,800

準備預金進捗率	99.98%	(実績)	73.33%	(日数)
---------	--------	------	--------	------

10/6のマネタリーベース		3,355,200		
10/6コール	合計	195,459	無担	61,011
			有担	134,448
コール前日増減	計	4,275	無担	787
			有担	3,488

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 ～0.125 (0.076)	0.030 ～0.040 (0.031)			0.060 ～0.125 (0.077)			0.030 ～0.040 (0.031)	
0.070 ～0.121 (0.080)				T/N		0.070 ～0.121 (0.079)		
0.078 (0.078)				S/N				
0.070 ～0.122 (0.080)				1W		0.117 (0.117)		
0.118 ～0.310 (0.135)				2W		0.170 (0.170)		
0.118 (0.118)				3W				
0.170 (0.170)		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	-	3M				
		-	▲0.077-▲0.05	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

全店共通	15,000億円	10/9	～	1/19 (102日間)	応札	3,393億円	落札	3,393億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	964億円	10/7	～	10/8 (1日間)	応札	480億円	落札	480億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)

<<日銀金融政策決定会合・結果>>

・マネタリーベースが、年間約80兆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。(賛成8反対1)

・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)

- ①長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。買入れの平均残存期間は7年～10年程度とする。
- ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約3兆円、年間約900億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。」

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

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	2,406,100	前日比	▲ 3,000
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。					

<< 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、前日比7,000億円増の181兆4,000億円(当座預金残高見込みは241兆円)。朝方の無担O/Nは、都銀は0.07～0.075%、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。一部業態からまとまった金額を0.077～0.078%前後で取り上げる場面も見られたものの、総じて取り急ぐ動きはなく、一巡後は0.07%前後を中心とした出合いで推移し、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。3M物の共通担保オペが1兆5,000億円オファーされ、結果は落札総額3,393億円(期落ち額733億円)で札割れとなった。

<< 7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。短国市場は全般的に材料なく閑散な中、6M物が週末の短国買入オペを睨んでか、▲0.077～▲0.05%まで買い進まれる展開となった。CP市場は、一部に大型の発行案件が見られ、全体の発行額は1,200億円程度まで膨らんだ。発行レートは引き続き低位横ばい圏での推移となった。

<< 8日の材料 >>

*金融経済月報

*8月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+3.2%)

*8月の国際収支

*9月の景気ウォッチャー調査

*英中銀(MPC) 結果発表

*国庫短期証券入札(3ヶ月、48,000億円、10/13発行)

*30年利付国債入札(8,000億円、10/13発行)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	120.25-26
0.325	0.005	18,322.98	136.88	為替(5時)	120.01-02

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	10/5	10/6	10/7
日銀当預残	2,422,400	2,423,600	2,405,700	2,374,700	2,394,700	2,409,100
準備預金残	2,206,700	2,202,100	2,188,000	2,162,200	2,177,800	2,188,200
レート	0.010%	0.076%	0.076%	0.077%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07457%	0.07600%	0.07600%	0.07620%	0.07633%	0.07629%