

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/9/2(火)

<<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,200	1,000	0
財政		▲ 16,100	▲ 3,800	2,000
資金過不足		▲ 14,900	▲ 2,800	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
99,691				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		17,500		
国庫短期証売却				
国債買入		6,400	2,500	
CP等買入				
		▲ 100	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488				
被災地支援				
3,522				
社債等買入				
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		23,900	2,500	0
当預増減		9,000	▲ 300	2,000

当座預金残高	1,506,400	9/2以降の残り所要積立額	24,700
準備預金残高	1,375,600	9/3以降の残り所要積立額	22,000
積み終了先	1,156,500	積数	1,700
超過準備	1,156,500	1日平均	1,700
非準備先残高	130,800	積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	1,900,800
準備預金進捗率	98.84% (実績)		58.06% (日数)

9/1のマナタリーベース		2,410,600	
9/1コール 合計	159,095	無担	61,400
有担		有担	97,695
コール前日増減	計	▲ 1,075	無担
		▲ 2,358	有担
			1,283

9/2の加重平均レート(速報)			
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国
0.050 ~0.135 (0.070)	0.030 ~0.040 (0.031)		
0.065 ~0.120 (0.070)			
0.117 ~0.125 (0.123)			
0.118 (0.118)			
0.115 ~0.116 (0.116)			
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-
		0.08-0.12	-
		0.08-0.12	-
		-	-
		-	-

9/3の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,506,100	前日比	▲ 300
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 2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1兆円増加の115兆8,000億円(当座預金残高見込みは150兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06%前後、地銀・信託・証券業態からは0.065%近辺の調達希望で始まり、0.065%を中心とした出合いで始まった。一巡後は0.06~0.065%での出合いで推移した。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<< 2日のオープン市場動向 >>  
 短国現先レートは小幅低下となった。短国市場は、品薄感が強く売り物に乏しいことから、閑散状態が続いていた。CP市場は、償還総額1,100円程度に対し発行総額は800億円弱となった。発行レートは、9月末償還物においては小幅上昇で決着する銘柄も見られたものの、概ね横ばい圏での動きとなった。

- << 3日の材料 >>
- \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、4日まで)
  - \*米国ページブック
  - \*米国7月の製造業新規受注・出荷・在庫
  - \*MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
  - \*ユーロ圏4-6月期のGDP改定値
  - \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、9/8発行)
  - \*交付税特別会計借入(10,500億円、9/11借入)

コール8月の加重平均レート			
(土日を含む)	無担	0.06855%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06862%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.500	0.005	日経平均株価(終値)	15,668.60	192.00	為替(9時)	104.35-36
						為替(5時)	104.83-85

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	8/26	8/27	8/28	8/29	9/1	9/2
日銀当預残	1,528,100	1,528,500	1,525,200	1,520,600	1,497,400	1,506,400
準備預金残	1,395,900	1,391,700	1,381,000	1,389,000	1,365,000	1,375,600
レート	0.071%	0.067%	0.074%	0.070%	0.068%	0.070%
月中平均	0.06823%	0.06819%	0.06839%	0.06855%	0.06800%	0.06900%

9/1の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担当日分	無担先日付分	有担当日分	有担先日付分		
0.050 ~0.135 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)			
	0.063 ~0.120 (0.076)				
	0.260 ~0.400 (0.330)				
	0.118 (0.118)				
	0.118 (0.118)				
				有担先日付分	

## <<オペ情報、入札結果>>

10年利付国債(表面利率0.5%) 応札7兆8,824億円 落札2兆1,999億円(I非競争入札:1,917億円) 9/22~2024/9/20 0.521% 按分63.4630% 平均0.517%

「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