

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/9/11(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	11日需給速報		12日需給予想		16日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 600	▲ 1,000		
財政		5,400	▲ 400	▲ 11,000		
資金過不足		4,800	▲ 1,000	▲ 10,000		
貸出			▲ 100			
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
97,081						
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入		5,000				
国庫短期証売却						
国債買入			5,500			
CP等買入						
		▲ 300	▲ 600			
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 133,488						
被災地支援						
3,522						
社債等買入			▲ 200			
ETF買入						
国債補完供給						
小計		4,700	4,600	0		
当預増減		9,500	3,600	▲ 10,000		

当座預金残高	1,518,800	9/11以降の残り所要積立額	4,500
準備預金残高	1,386,500	9/12以降の残り所要積立額	2,200
積み終了先	1,172,700	積数	600
超過準備	1,172,100	1日平均	
非準備先残高	132,300		
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	1,907,800		
準備預金進捗率	99.88% (実績)	87.10% (日数)	

9/10のマナターベース		2,416,200	
9/10コール	合計	161,678	無担 61,337 有担 100,341
コール前日増減	計	7,747	無担 6,623 有担 1,124

9/11の加重平均レート(速報)			9/10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	無担先日付分	有担当日分
0.050 ~0.135 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.135 (0.071)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.067 ~0.121 (0.080)				T/N	0.066 ~0.135 (0.081)	
				S/N		
0.071 ~0.200 (0.103)				1W 0.117 (0.117)	0.099 ~0.150 (0.112)	
0.118 (0.118)				2W	0.118 ~0.330 (0.131)	
				3W	0.130 (0.130)	
0.255 ~0.600 (0.428)		0.08-0.12	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	▲0.001	2M		
		0.08-0.12	▲0.01-▲0.009	3M		
		-	▲0.015-▲0.01	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

T-Bill3M 応札28兆284億5,000万円 落札5兆1,852億4,000万円(非競争入札:4,747億円) 9/16~12/15 0.0060% 按分89.2441% 平均0.0028%
 5年利付国債(表面利率0.2%) 応札9兆677億円 落札2兆4,551億円(1非競争入札:2,417億円) 9/22~2019/9/20 0.179% 按分80.1626% 平均0.179%
 J-REIT買入 6億円 約定日9/11

「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

<< 9/12の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,522,400	前日比	3,600
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。					

<< 11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8,000億円増加の117兆4,000億円(当座預金残高見込みは151兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06%、地銀・信託業態から0.065~0.066%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.066%を中心とした出合いになった。一巡以降は0.06~0.067%で推移した。ターム物は、1W~1M物の期間で大手行による調達が見られた。

<< 11日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばい圏での推移となった。短国市場はマイナスでの出合いが見られるなど、品薄感が強い中、3M物の入札が実施された。落札結果は平均落札利回0.0028%、按分利回0.0060%と0%近辺での決着となった。CP市場は電機業態からのまとまった発行案件が見られ、発行総額は1,400億円程度となった。発行レートは引続き横ばい圏での推移となった。

<< 12日の材料 >>
 *7月の石油等消費動向統計
 *黒田日銀総裁、政策研究大学院大学にて講演
 *米国7月の企業在庫 *米国8月の小売売上高
 *米国9月のミシガン大消費者信頼感指数速報

JGB新発10年債	0.560	0.015	日経平均株価(終値)	15,909.20	120.42	為替(9時)	106.84-85
						為替(5時)	106.86-87

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	9/4	9/5	9/8	9/9	9/10	9/11
日銀当預残	1,515,200	1,526,300	1,520,600	1,519,600	1,509,300	1,518,800
準備預金残	1,381,900	1,399,400	1,384,800	1,388,200	1,374,100	1,386,500
レート	0.074%	0.070%	0.067%	0.067%	0.071%	0.067%
月中平均	0.07025%	0.07014%	0.06975%	0.06944%	0.06960%	0.06936%