

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/9/12(金) <<セントラル短資株式会社>>

《資金需給》

単位 億円

	12日需給速報		16日需給予想	17日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	1,400	1,000
財政		▲ 1,600	▲ 16,000	0
資金過不足		▲ 2,200	▲ 14,600	1,000
貸出				
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				2,500
国庫短期証売却				
国債買入		5,500		
CP等買入				
		▲ 600	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,353				25,900
被災地支援				
3,522				
社債等買入		▲ 200	▲ 500	1,500
ETF買入				
国債補充供給				
小計		4,700	▲ 800	29,600
当預増減		2,500	▲ 15,400	30,600

当座預金残高	1,521,300	9/12以降の残り所要積立額	2,200
準備預金残高	1,390,800	9/16以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,178,400	積数	1,844,100
超過準備	1,177,800	1日平均	61,500
非準備先残高	130,500	積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	1,907,800
9月の新所要見込		61,500 (一日平均)	

9/11のマナタリーベース		2,426,400	
9/11コール	合計 159,883	無担 60,200	有担 99,683
コール前日増減	計 ▲ 1,795	無担 ▲ 1,137	有担 ▲ 658

9/12の加重平均レート(速報)			9/11の加重平均レート(確報)		
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
0.060 ~0.135 (0.070)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.135 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.066 ~0.125 (0.085)				T/N	0.067 ~0.121 (0.080)
				S/N	
0.071 ~0.400 (0.117)				1W	0.071 ~0.200 (0.094)
0.115 (0.115)				2W	0.118 (0.118)
				3W	
0.075 (0.075)		0.08-0.12	-	1M	0.255 ~0.600 (0.428)
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.01 - ▲0.015	3M	
		-	-	6M	
		-	-	1Y	

《オペ情報、入札結果》

国短買入	2,500億円	9/17	応札	5,447億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	-0.009%	88.8%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	3,000億円	9/22	応札	8,208億円	落札	3,005億円	按分利回り較差	0.003%	68.4%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,000億円	9/22	応札	7,924億円	落札	2,000億円	全取利回り較差	0.005%		平均利回り較差	0.005%
国債買入	1,000億円	9/22	応札	3,116億円	落札	1,004億円	按分利回り較差	0.007%	3.9%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	300億円	9/22	応札	1,334億円	落札	301億円	按分利回り較差	-0.005%	88.0%	平均利回り較差	-0.003%
貸出増加支援	9/17~2015/9/17 (365日間)		貸付予定総額	0億円	貸付利率	0.10%					
貸出増加支援	9/17~2016/9/16 (730日間)		貸付予定総額	0億円	貸付利率	0.10%					
貸出増加支援	9/17~2017/9/15 (1,094日間)		貸付予定総額	0億円	貸付利率	0.10%					
貸出増加支援	9/17~2018/9/14 (1,458日間)		貸付予定総額	25,865億円	貸付利率	0.10%					
J-REIT買入	6億円	約定日	9/12								

9/16の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,505,900	前日比	▲ 15,400
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。

《 12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3,000億円増加の117兆7,000億円(当座預金残高見込みは152兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06~0.065%、地銀・信託業態から0.065~0.069%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.067~0.07%を中心とした出合いになった。一巡以降は0.065~0.069%での出合いで推移した。ターム物は動意に乏しい展開となった。

《 12日のオープン市場動向 》

現先S/N物は低位横ばい圏での推移となった。短国市場は、短国買入オペが2,500億円に減額されて実施された。平均利回り較差±0.000%・按分利回り較差▲0.009%と売り物の乏しいマーケットを反映した、強めの結果となった。CP市場はノンバンク業態からのまとまった発行案件が見られたものの、発行案件全体としては少なく、閑散とした地合となった。発行レートは投資家の購入ニーズが強く、小幅低下での動きとなった。

《 16日の材料 》

- *米国FOMC (1日目)
- *米国8月の生産者物価指数
- *英国8月の消費者物価指数

《コール8月積み期間分の加重平均レート》

(土日を含む)	無担	0.06923%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06920%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	0.570	0.010	日経平均株価(終値)	15,948.29	39.09	為替(9時)	107.12-13
						為替(5時)	107.19-20

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	9/5	9/8	9/9	9/10	9/11	9/12
日銀当預残	1,526,300	1,520,600	1,519,600	1,509,300	1,518,800	1,521,300
準備預金残	1,399,400	1,384,800	1,388,200	1,374,100	1,386,500	1,390,800
レート	0.070%	0.067%	0.067%	0.071%	0.067%	0.070%
月中平均	0.07014%	0.06975%	0.06944%	0.06960%	0.06936%	0.06953%

「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