

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/9/16(火) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	16日需給速報		17日需給予想	18日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,400	1,200	▲1,000
財政		▲17,600	0	1,000
資金過不足		▲16,200	1,200	0
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				
CP等買入				
		▲300	▲400	
貸出支援基金			25,900	
(成長) 38,608				
(増加) 133,488			▲300	
被災地支援				
3,522				
社債等買入		▲500	1,500	
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲200	200	
小計		▲1,000	29,400	0
当増増減		▲17,200	30,600	0
当座預金残高	1,504,100	9/16以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,374,600	1,844,100		
積み終了先	367,400	9/17以降の残り所要積立額		
超過準備	302,900	積数 974,700		
非準預先残高	129,500	1日平均 33,600		
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)		1,844,100		
準備預金進捗率	47.14%	(実績)	3.33%	(日数)

<< 9/17の日銀調節とレート予想 >>

日銀調節	見送り	当座預金残高	1,534,700	前日比	30,600
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となる見込み。

<< 16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、前営業日比3,000億円減の117兆4,000億円(当座預金残高見込みは150兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、週末要因が剥落した事から、地銀・信託・証券業態から0.063~0.066%での調達、大手行からは0.06%での調達希望と落ち着いて始まった。一巡後は、散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W物0.117%、2W~1M物で0.118%のまとまった調達が見られた。

<< 16日のオープン市場動向 >>

短国現先は前日からレート横ばい圏。短国アウトライト市場は、入札、オペ等のイベントが無い中で売り気配が見えず、3Mがマイナス圏で小額の出合いがあった。CP市場は償還総額1,000億円程度に対し、発行総額1,300億円程度。発行レートは概ね横ばい圏ながら、一部a-1プラス格で9月末を越える銘柄に強めの決着となるものがあった。

<< 17日の材料 >>

- *米国FOMC(2日目)
- *米国FRB経済見通し発表
- *米国8月の消費者物価指数
- *ECB定例理事会(1日目、金融政策発表なし)
- *ユーロ圏8月の消費者物価指数改定値
- *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、9/22発行)
- *20年利付国債入札(12,000億円、9/22発行)

<<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		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.575	0.005	15,911.53	▲36.76	107.14-15	
				為替(5時)	107.10-11

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	9/8	9/9	9/10	9/11	9/12	9/16
日銀当預残	1,520,600	1,519,600	1,509,300	1,518,800	1,521,300	1,504,100
準備預金残	1,384,800	1,388,200	1,374,100	1,386,500	1,390,800	1,374,600
レート	0.067%	0.067%	0.071%	0.067%	0.070%	0.067%
月中平均	0.06975%	0.06944%	0.06960%	0.06936%	0.06953%	0.06938%

9/12のマネタリーベース			
9/12コール合計	160,245	無担	60,148
有担	100,097		
コール前日増減	計	362	無担 ▲52
			有担 414

9/16の加重平均レート(速報)				9/12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	~0.125 (0.067)	0.030	~0.040 (0.031)			O/N	0.060	~0.135 (0.070)	0.030	~0.040 (0.031)
0.065	~0.120 (0.076)					T/N		0.066	~0.125 (0.085)	
						S/N				
0.117	~0.280 (0.144)					1W	0.071	(0.071)	0.130	~0.400 (0.219)
0.130	(0.130)					2W			0.115	(0.115)
						3W				
0.075	~0.340 (0.111)			0.08-0.12	-	1M			0.075	(0.075)
				0.08-0.12	-	2M				
				0.08-0.12	▲0.015	3M				
				-	-	6M				
				-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	3,146億円	9/16 ~ 9/17 (1日間)	応札	168億円	落札	168億円	-0.400%	全取	平均	-0.400%(即)
国債補完	2,000億円	9/16 ~ 9/22 (6日間)	応札	6億円	落札	6億円	-0.400%	全取	平均	-0.400%(即)
米ドル資金供給(固定金利方式)		9/18~9/26 (8日間)	応札	300万ドル	落札	300万ドル	貸付利率	0.590%		
J-REIT買入	6億円	約定日	9/16							

「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