

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/9/22(月) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	22日需給速報		24日需給予想	25日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 800	▲ 400	▲ 1,000
財政		56,400	▲ 2,600	3,000
資金過不足		55,600	▲ 3,000	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,500		
98,018		▲ 1,600		
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		11,900	6,100	
CP等買入		5,400		
		▲ 400	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援				
3,522				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		17,700	23,300	0
当預増減		73,300	20,300	2,000

当座預金残高	1,603,700	9/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,480,500		145,200
積み終了先	1,211,700	9/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,200,000	積数	92,700
非準備先残高	123,200	1日平均	4,200
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	94.97% (実績)		26.67% (日数)

9/19のマナタリーベース		2,437,600	
9/19コール合計	166,563	無担	65,036
コール前日増減	計 4,859	無担	3,649
		有担	101,527
		有担	1,210

9/22の加重平均レート(速報)			9/19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
0.030 ~0.135 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.135 (0.069)	
0.065 ~0.120 (0.073)				T/N	0.061 ~0.120 (0.092)
				S/N	0.110 ~0.121 (0.117)
0.117 (0.117)				1W	0.071 ~0.400 (0.130)
0.116 ~0.330 (0.124)				2W	0.270 (0.270)
				3W	
0.118 (0.118)		0.08-0.12	▲0.005	1M	0.075 ~0.200 (0.115)
		0.08-0.12	▲0.005	2M	
		0.08-0.12	▲0.005-▲0.020	3M	
		-	0.0000	6M	
		-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

本日は日本銀行による調節はありませんでした。

<< 9/24の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,624,000	前日比	20,300
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。

<< 22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2兆7,000億円増の122兆8,000億円(当座預金残高見込みは160兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.063~0.066%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。国債の大量償還・利払い日にあたり、当座預金残高が過去最高を更新する中、調達ニーズは限定的で、終日落ち着いた取引となった。ターム物は、大手行から2W~1M物で0.118%での調達が見られた。

<< 22日のオープン市場動向 >>

現先レートは横ばい圏での推移となった。短国市場は品薄感が強く、全般的に閑散な中、3M物が▲0.020%まで買い進まれた。CP市場は25日発行となり、通信・自動車・石油業態でまとまった発行が見られたことで、発行総額は2,900億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいでの推移となっていた。

<< 24日の材料 >>

*米国8月の新築一戸建て販売件数

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	108.94-95
0.540 ▲ 0.020	16,205.90 ▲ 115.27	為替(5時)	108.89-91

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	9/12	9/16	9/17	9/18	9/19	9/22
日銀当預残	1,521,300	1,504,100	1,534,400	1,533,600	1,530,400	1,603,700
準備預金残	1,390,800	1,374,600	1,405,100	1,411,300	1,399,800	1,480,500
レート	0.070%	0.067%	0.066%	0.068%	0.069%	0.065%
月中平均	0.06953%	0.06938%	0.06918%	0.06911%	0.06910%	0.06874%

「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録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