

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/9/29(月) <セントラル短資株式会社>

<<資金需給>>

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想	1日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	700	1,000
財政		▲ 25,900	4,900	▲ 8,000
資金過不足		▲ 26,000	5,600	▲ 7,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
98,018				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			10,000	
国庫短期証売却				
国債買入			1,600	9,000
CP等買入			4,500	
		▲ 600	▲ 6,900	
貸出支援基金(成長)				
38,608				
(増加) 159,053				
被災地支援				
3,689				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 300		
		100	300	
小計		▲ 800	9,500	9,000
当預増減		▲ 26,800	15,100	2,000

当座預金残高	1,600,800	9/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,477,400		36,900
積み終了先	1,225,600	9/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,224,300	積数	31,500
非準備先残高	123,400	1日平均	2,000
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	98.29%	(実績)	46.67% (日数)

9/26のマネタリーベース		2,538,900	
9/26コール合計	181,873	無担	70,179
有担			111,694
コール前日増減	▲ 2,111	無担	▲ 1,799
有担			▲ 312

9/29の加重平均レート(速報)				9/26の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.050 ~0.135 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)	CP気配a-1	短国	O/N	0.050 ~0.135 (0.066)	無担先日付分	有担先日付分
0.020 ~0.125 (0.025)				T/N		0.070 ~0.125 (0.112)	
0.055 ~0.400 (0.126)				S/N		0.050 ~0.150 (0.064)	
0.145 (0.145)				1W		0.125 (0.125)	
				2W		0.117 ~0.118 (0.117)	
				3W			
0.118 ~0.170 (0.120)		0.08-0.12	-	1M		0.090 (0.090)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.005-0.000	3M	0.140 (0.140)		
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,598億円	9/29	~ 9/30 (1日間)	応札	252億円	落札	252億円	-0.400%	全取	平均	-0.409% (即)
国債買入	3,000億円	10/1	応札	8,753億円	落札	3,007億円	按分利回り較差	0.008%	64.5%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	2,000億円	10/1	応札	5,729億円	落札	2,001億円	按分利回り較差	0.006%	93.1%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	10/1	応札	13,439億円	落札	4,014億円	按分利回り較差	-0.005%	78.4%	平均利回り較差	-0.005%

「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

<< 9/30の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,615,900	前日比	15,100
O/N	0.02~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12
無担O/Nは、調達ニーズが弱く、軟調な展開が予想される。					

<< 29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2兆5,000億円減の122兆8,000億円(当座預金残高見込みは160兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、信託業態から0.064~0.065%、地銀・証券業態から0.061~0.063%、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。資金需給上は大幅な不足日であったが、調達ニーズは限定的であった。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、目立った出合いは見られなかった。

<< 29日のオープン市場動向 >>

現先レートは前日比横ばい圏での推移となった。短国アウトライト市場は特段のイベントも無く様子見閑散状態が続いており、3M物に若干のマイナスから0%付近での小額の出合いが見られた程度であった。CP市場は期末に残高を落とした鉄鋼業態などの発行再開により、発行金額は2,700億円程度に膨らんだ。発行レートは引き続き小幅低下基調での推移となっていた。

<< 30日の材料 >>

- *8月の完全失業率(市場予想: 3.8%)
- *8月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比▲3.8%)
- *8月の有効求人倍率(市場予想: 1.10倍)
- *8月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想: 前月比+0.2%)
- *8月の商業販売統計速報 *8月の毎月勤労統計調査速報 *8月の住宅着工統計
- *米国7月のS & P/ケース・シラー住宅価格指数
- *米国9月のCB消費者信頼感指数 *米国9月のシカゴPM景況感指数
- *英国4-6月期のGDP確報値 *ユーロ圏9月の消費者物価指数速報値
- *2年利付国債入札(27,000億円、10/15発行)

JGB新発10年債	0.520	0.005	日経平均株価(終値)	16,310.64	80.78	為替(9時)	109.39-41
						為替(5時)	109.60-62

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	9/19	9/22	9/24	9/25	9/26	9/29
日銀当預残	1,530,400	1,603,700	1,624,500	1,622,000	1,627,600	1,600,800
準備預金残	1,399,800	1,480,500	1,500,400	1,497,500	1,501,000	1,477,400
レート	0.069%	0.065%	0.066%	0.073%	0.066%	0.066%
月中平均	0.06910%	0.06874%	0.06863%	0.06880%	0.06850%	0.06841%