

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/1/20(月) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	20日需給速報		21日需給予想		22日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,700		1,600		1,000
財政		▲ 39,200		2,100		1,000
資金過不足		▲ 37,500		3,700		2,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		3,000				1,700
173,285		▲ 4,700				▲ 1,900
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入				25,000		
国庫短期証売却						
国債買入		7,100				5,100
CP等買入						
		▲ 300		▲ 100		
貸出支援基金 (成長) 34,599 (増加) 50,859						
被災地支援						
3,804						
社債等買入				▲ 100		900
ETF買入				100		
国債補充供給						
小計		5,100		24,900		5,800
当増減		▲ 32,400		28,600		7,800

<< 1/21の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,091,500	前日比	28,600
O/N	0.06~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07%前後の出合いが中心となるであろう。

<< 20日のインターバンク市場動向 >>  
 午前8時発表の準備預金先残高見込は83兆3,000億円。朝方の無担O/Nは、地銀、信託業態から0.07%台前半、大手行からは0.06%の調達希望。出合いの中心は0.072%と、先週末よりもこじっかりとした立ち上がりとなった。一巡後もさほどレートは低下せず、0.07%近辺での出合いが散見され、午前の取引を終えた。後場に入ると、ビッドが薄くなり、0.06%へのギブンも見られた。ターム物は、大手行が1W物0.117%、2W、1M物0.118%で調達を行った。

<< 20日のオープン市場動向 >>  
 現先S/N物は横ばい圏での動き。短国市場はアウトライト市場で2M 0.063%、3M 0.059%での出合いが見られた程度で、全般的に動意なく閑散とした地合いとなった。CP市場は償還総額1,100億円に対し発行総額900億円程度。発行レートは概ね横ばい圏での動き。

<< 21日の材料 >>  
 \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、22日まで)  
 \*国庫短期証券入札(2ヶ月、25,000億円、1/24発行)  
 \*5年利付国債入札(27,000億円、1/23発行)  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、1/30借入)

<<コール12月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07187%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07235%	有担 0.04100%

当座預金残高	1,062,900	1/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	964,800		285,900
積み終了先	795,200	1/21以降の残り所要積立額	
超過準備	794,500	積数	246,400
非準備先残高	98,100	1日平均	9,500
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,881,100		
準備預金進捗率	86.90% (実績)	16.13%	(日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	104.24-25
0.660 ▲ 0.010	15,641.68 ▲ 92.78	為替(5時)	104.21-23

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	1/10	1/14	1/15	1/16	1/17	1/20
日銀当預残	1,107,100	1,094,000	1,053,400	1,096,100	1,095,300	1,062,900
準備預金残	1,005,700	999,300	968,700	988,100	989,100	964,800
レート	0.074%	0.072%	0.072%	0.071%	0.071%	0.072%
月中平均	0.07100%	0.07107%	0.07113%	0.07113%	0.07111%	0.07115%

1/17のマナターベース			
1/17コール 合計	175,373	無担	62,283
有担	113,090		
コール前日増減	計 ▲ 3,590	無担 ▲ 2,822	有担 ▲ 768

1/20の加重平均レート(速報)				1/17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		有担当日分	
0.060 ~0.085 (0.072)	0.040 ~0.050 (0.041)					O/N	0.060 ~0.085 (0.071)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.070 ~0.120 (0.081)						T/N		0.071 ~0.120 (0.087)	
0.125 (0.125)						S/N			
0.153 (0.153)						1W	0.130 (0.130)	0.116 ~0.400 (0.125)	
0.150 ~0.180 (0.160)						2W		0.118 ~0.300 (0.141)	
						3W			
0.118 (0.118)				0.07-0.13	-	1M		0.118 (0.118)	有担先日付分
				0.07-0.13	0.0630	2M			
				0.07-0.13	0.0590	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

## <<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	1/22	~ 4/17 (85日間)	応札	1,661億円	落札	1,661億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	1,100億円	1/22		応札	6,410億円	落札	1,112億円	0.006%	59.7%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	1/22		応札	13,874億円	落札	4,005億円	-0.010%	1.1%	平均利回り較差	-0.008%

「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