

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/1/22(水)

《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		23日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	▲ 700	▲ 1,000
財政		2,500	▲ 24,500	2,000
資金過不足		2,700	▲ 25,200	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,700		
173,093		▲ 1,900		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入		5,100		
CP等買入				4,000
		▲ 600	▲ 200	
貸出支援基金				
(成長) 34,599				
(増加) 50,859				
被災地支援			0	
3,804				
社債等買入		900		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		5,200	▲ 200	4,000
当預増減		7,900	▲ 25,400	5,000

当座預金残高	1,098,000	1/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	986,400		212,700
積み終了先	830,300	1/23以降の残り所要積立額	
超過準備	829,100	積数	186,500
非準預金残高	111,600	1日平均	7,800
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	90.09%	(実績)	22.58% (日数)

1/21のマネタリーベース		1,994,200	
1/21コール	合計	176,055	無担 64,197 有担 111,858
コール前日増減	計	▲ 221	無担 ▲ 2,341 有担 2,120

1/22 の加重平均レート(速報)					1/21 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	
0.060 ~0.085 (0.071)		0.040 ~0.050 (0.041)				O/N	0.060 ~0.085 (0.071)			0.040 ~0.050 (0.041)	
0.070 ~0.125 (0.084)						T/N			0.071 ~0.125 (0.094)		
						S/N					
0.117 (0.117)						1W			0.117 ~0.118 (0.117)		
0.180 (0.180)						2W			0.077 ~0.340 (0.113)		
						3W					
0.118 (0.118)				0.07-0.13	-	1M			0.118 (0.118)	有担先日付分	
				0.07-0.13	0.0600	2M					
				0.07-0.13	0.0570-0.0575	3M					
				-	0.0550	6M					
				-	0.0530	1Y					

《オペ情報、入札結果》

米ドル資金供給(固定金利方式) 1/24~1/30 (6日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.580%

《日銀金融政策決定会合・結果》

・マネタリーベースが、年間約60~70兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(全員一致)

・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。

①長期国債について、保有残高が年間約50兆円に相当するペースで増加し、平均残存期間が7年程度となるよう買入れを行う。

②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約1兆円、年間約300億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。

③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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

《 1/23の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,072,600	前日比	▲ 25,400
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。					

《 22日のインターバンク市場動向 》

午前8時発表の準備預金先残高見込は85兆7,000億円。朝方の無担O/Nは、信託業態から0.07%台前半、地銀業態から0.07%付近、大手行からは0.06%前後での調達希望。出合いの中心は0.07%と昨日よりも弱めの立ち上がりとなった。一巡後は徐々にビッドが消え、0.06~0.065%の出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物0.117%での調達を行っていた。

《 22日のオープン市場動向 》

現先S/N物は強含みで横ばい。短国市場は3M物の入札を控えて様子見姿勢が強まる中、2M0.060%、3M0.057~0.0575%、6M0.055%、1Y0.053%での出合いが見られ堅調な相場となった。CP市場は償還総額1,000億円程度に対し、電機、鉄鋼セクターからまとまった発行案件が見られ発行総額は4,500億円程度まで膨らんだ。発行レートは先日のオペの影響からか、全体的に小幅上昇となった。

《 23日の材料 》

*日銀金融経済月報

*米国12月の中古住宅販売

*国庫短期証券(3カ月、57,000億円、1/27発行)

*20年利付国債入札(12,000億円、1/27発行)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	104.22-23
0.675	▲ 0.005	15,820.96	25.00	為替(5時)	104.36-38

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	1/15	1/16	1/17	1/20	1/21	1/22
日銀当預残	1,053,400	1,096,100	1,095,300	1,062,900	1,090,100	1,098,000
準備預金残	968,700	988,100	989,100	964,800	984,100	986,400
レート	0.072%	0.071%	0.071%	0.072%	0.071%	0.071%
月中平均	0.07113%	0.07113%	0.07111%	0.07115%	0.07114%	0.07114%