

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/1/31(金) <セントラル短資株式会社>

## <<資金需給>>

単位 億円

	31日需給速報		3日需給予想		4日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		100		1,600		2,000
財政		3,200		▲ 7,900		▲ 27,000
資金過不足		3,300		▲ 6,300		▲ 25,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)				3,200		
173,722				▲ 5,100		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						20,000
国庫短期証売却						
国債買入		6,200				9,000
CP等買入		3,800				
		▲ 3,700		▲ 100		
貸出支援基金(成長)		34,599				
(増加)		50,859				
被災地支援		3,805				
社債等買入						
ETF買入						
国債補完供給						
小計		6,300		▲ 2,000		29,000
当預増減		9,600		▲ 8,300		4,000

当座預金残高	1,104,900	1/31以降の残り所要積立額	70,600
準備預金残高	1,000,000	2/3以降の残り所要積立額	46,900
積み終了先	864,300	積数	3,600
超過準備	864,300	1日平均	3,600
非準備先残高	104,900		
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,874,200		
準備預金進捗率	97.50% (実績)	58.06% (日数)	

1/30のマネタリーベース		1,999,300	
1/30コール	合計	173,839	無担 61,657 有担 112,182
コール前日増減	計	▲ 7,019	無担 ▲ 8,577 有担 1,558

1/31の加重平均レート(速報)				1/30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	
0.060 ~0.085 (0.071)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.060 ~0.145 (0.070)			
0.070 ~0.120 (0.082)					0.120 ~0.125 (0.121)		
0.125 (0.125)					0.125 (0.125)		
0.121 ~0.400 (0.199)					0.118 (0.118)		
0.116 ~0.300 (0.248)					0.150 (0.150)		
		0.08-0.13	-				
		0.08-0.13	0.0450				
		0.08-0.13	0.0500				
		-	-				
		-	-				

## <<オペ情報、入札結果>>

国短買入	20,000億円	2/4	応札	50,545億円	落札	20,008億円	按分利回り較差	0.000%	39.2%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	2,500億円	2/4	応札	8,580億円	落札	2,506億円	按分利回り較差	-0.002%	38.7%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	2,500億円	2/4	応札	10,565億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	0.004%	33.0%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	2/4	応札	13,416億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	0.008%	32.1%	平均利回り較差	0.009%
交付税特会	1兆500億円	2/12~8/13	応札	3兆2,187億円	落札	1兆500億100万円	0.101%	按分	49.0955%	平均	0.101%

「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

<< 2/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,096,600	前日比	▲ 8,300
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。

<< 31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87兆5,000億円。朝方の無担O/Nは、信託業態から0.07%近辺、都銀・地銀業態からは0.06%台半ばでの調達希望。出合いの中心は0.07~0.071%と、落ち着いた立ち上がりとなった。一巡後はベストビッドが0.065%まで低下し、閑散な出合いで今月の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いはなく、本日もロール案件での出合いが数件見られる程度であった。

<< 31日のオープン市場動向 >>  
現先S/N物は短国・CP共に低位安定。短国市場では、短国買入オペが前回比5,000億円減額となる2兆円を実施された。落札結果は、平均利回較差+0.001%、按分利回較差±0%と市場実勢を反映した結果となった。CP市場は、引合いベースで償還総額1,100億円程度に対して、発行総額は1,000億円弱となった。発行レートは概ね横ばい圏での動き。

<< 1日の材料 >>  
\*イエレン氏、FRB議長に就任

<< 3日の材料 >>  
\*1月実績/2月見込み財政資金対民間収支  
\*米国1月のISM製造業景況指数  
\*米国12月の建設支出

<<コール1月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07184%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07258%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.73-74
0.620	0.000	14,914.53	▲ 92.53
		為替(5時)	102.48-50

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	1/24	1/27	1/28	1/29	1/30	1/31
日銀当預残	1,075,300	1,058,300	1,097,700	1,099,200	1,095,300	1,104,900
準備預金残	974,600	962,400	990,300	985,800	989,000	1,000,000
レート	0.072%	0.072%	0.070%	0.091%	0.070%	0.071%
月中平均	0.07127%	0.07130%	0.07125%	0.07193%	0.07187%	0.07184%