

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/7/4(金) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		7日需給予想	8日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	1,100	1,000
財政		4,800	▲ 28,500	▲ 1,000
資金過不足		4,500	▲ 27,400	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			2,700	
118,759			▲ 3,700	
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				5,100
CP等買入				
		▲ 100	▲ 500	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488				
被災地支援				
3,785				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 200	200	
小計		▲ 300	▲ 1,300	25,100
当預増減		4,200	▲ 28,700	25,100

当座預金残高	1,531,700	7/4以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,400,200		13,200
積み終了先	1,180,200	7/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,179,300	積数	7,400
非準備先残高	131,500	1日平均	800
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)			1,841,300
準備預金進捗率	99.60% (実績)	70.00% (日数)	

7/3のマネタリーベース		2,438,000	
7/3コール	合計	150,678	無担 53,476 有担 97,202
コール前日増減	計	▲ 3,267	無担 ▲ 2,646 有担 ▲ 621

7/4の加重平均レート(速報)				7/3の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.050 ~0.135 (0.066)	0.040 ~0.050 (0.041)	CP気配a-1	短国	0.040 ~0.135 (0.065)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.063 ~0.125 (0.094)					0.063 ~0.065 (0.064)		
0.125 (0.125)							
0.065 (0.065)					0.081 ~0.340 (0.088)		
0.170 (0.170)							
		0.08-0.12	-				
		0.08-0.12	0.030~0.035				有担先日付分
		0.08-0.12	-				
		-	-				
		-	0.0280				

<< 7/7の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,503,000	前日比	▲ 28,700
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となろう。

<< 4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、前日比9,000億円増の117兆8,000億円(当座預金残高見込みは153兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態から0.065%での調達で始まった。出合いレートは、週末要因により、昨日までと比べてやや高くなった。一巡後は、ビッドが0.06~0.063%に低下し、散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件が数件見られた。

<< 4日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、若干低下して推移した。短国市場は、買入オペが実施され、按分落札利回り較差▲0.010%、按分率88.3%、平均落札利回り較差▲0.007%と堅調な結果となった。アウトライト市場は、短国買入オペ後に2M:0.03~0.035%、1Y:0.028%と目線を下げた出合いが見られた。CP市場は、鉄鋼・通信・商社業態からまとまった発行が実施され、発行総額は1,200億円程度となった。CP等買入オペは、按分利回り0.085%、按分率10.5%、平均落札利回り0.087%となり、前回比で按分・平均共に上昇した。

<< 7日の材料 >>
 *5月の景気動向指数速報 *6月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)

<<コール6月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06723%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06705%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	0.565	0.000	日経平均株価(終値)	15,437.13	88.84	為替(9時)	102.20-21
						為替(5時)	102.00-01

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	6/27	6/30	7/1	7/2	7/3	7/4
日銀当預残	1,538,900	1,523,200	1,543,000	1,516,300	1,527,500	1,531,700
準備預金残	1,405,800	1,394,000	1,405,900	1,377,300	1,390,300	1,400,200
レート	0.066%	0.058%	0.065%	0.065%	0.065%	0.066%
月中平均	0.06755%	0.06723%	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06550%

<<オペ情報、入札結果>>			
国債補完	2,000億円	7/4 ~ 7/7 (3日間) 応札	198億円
CP買入	4,000億円	7/9 応札	10,111億円 落札 3,989億円
国短買入	20,000億円	7/8 応札	31,837億円 落札 20,004億円
国債買入	1,100億円	7/8 応札	6,456億円 落札 1,102億円
国債買入	4,000億円	7/8 応札	15,264億円 落札 4,004億円
交付税特会	1兆500億円	7/17~2015/1/16 応札	3兆380億円 落札 1兆500億200万円
			0.100% 按分 38.1267% 平均0.098%

「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