

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/7/8(火)

《セントラル短資株式会社》

## 《資金需給》

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,200	300	0
財政		900	▲ 200	▲ 4,000
資金過不足		2,100	100	▲ 4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
117,699				
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		5,300	6,500	
CP等買入			4,000	
		▲ 100	▲ 100	
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		100		
国債補完供給				
小計		25,300	10,400	0
当預増減		27,400	10,500	▲ 4,000

当座預金残高	1,529,500	7/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,392,100		7,200
積み終了先	1,173,900	7/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,173,900	積数	6,100
非準備先残高	137,400	1日平均	900
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,852,500		
準備預金進捗率	99.67% (実績)		76.67% (日数)

7/7のマネタリーベース		2,411,800	
7/7コール	合計	149,592	無担 51,762 有担 97,830
コール前日増減	計	1,155	無担 691 有担 464

《 7/9の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,540,000	前日比	10,500
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。

《 8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2兆4,000億円増の117兆4,000億円(当座預金残高見込みは152兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.06~0.065%、大手行からは0.06%での調達で始まった。昨日と比べ、調達ニーズはやや弱く、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、ロール案件が見られた程度であった。

《 8日のオープン市場動向 》  
 現先S/N物は横ばい圏で推移となった。短国市場では6M物の入札が実施された。落札結果は、平均・按分落札利回り共に0.0213%と予想以上に強い結果となった。セカンダリーでは、ショートカバーから0%での出合いもみられた。CP市場では、償還総額1,700億円程度に対して発行総額は2,200億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。

《 9日の材料 》  
 \*5月の特定サービス産業動態統計速報  
 \*6月のマネーストック  
 \*MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)

JGB新発10年債	0.550	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	15,314.41	▲ 65.03	為替(9時)	101.81-82
						為替(5時)	101.80-82

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	7/1	7/2	7/3	7/4	7/7	7/8
日銀当預残	1,543,000	1,516,300	1,527,500	1,531,700	1,502,100	1,529,500
準備預金残	1,405,900	1,377,300	1,390,300	1,400,200	1,365,500	1,392,100
レート	0.065%	0.065%	0.065%	0.066%	0.065%	0.066%
月中平均	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06550%	0.06543%	0.06550%

7/8の加重平均レート(速報)				7/7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		
0.050 ~0.135 (0.066)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.135 (0.065)		0.040 ~0.050 (0.041)		
0.062 ~0.125 (0.068)				T/N	0.063 ~0.120 (0.065)			
				S/N				
0.071 ~0.200 (0.119)				1W	0.123 ~0.400 (0.179)			
0.145 (0.145)				2W				
				3W				
		0.08-0.12	0.0250	1M	0.270 (0.270)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.0150	3M				
		-	0.00-0.01	6M				
		-	0.0250	1Y				

## 《オペ情報、入札結果》

米ドル資金供給(固定金利方式) 7/10~7/17 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.590%  
 T-Bill6M 応札20兆2,326億円 落札3兆2,257億4,000万円(非競争入札:2,742億4,000万円) 7/10~2015/1/14 0.0213% 按分80.7449% 平均0.0213%  
 10年物価連動国債(表面利率0.1%) 応札1兆179億円 落札4,000億円 7/10~2024/3/10 ▲0.952% 按分90.0000%  
 ETF買入 144億円 約定日7/8  
 J-REIT買入 5億円 約定日7/8

「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