

2014/7/14(月)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	14日需給速報		15日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,300	900	0
財政		▲ 38,500	▲ 2,100	0
資金過不足		▲ 37,200	▲ 1,200	0
貸出			▲ 100	
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,800		
114,700		▲ 5,800		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			30,000	
国庫短期証売却				
国債買入			6,500	
CP等買入				
		▲ 200	▲ 400	
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			▲ 100	1,000
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		▲ 3,100	36,000	1,000
当預増減		▲ 40,300	34,800	1,000
当座預金残高	1,495,600	7/14以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,360,700	1,100		
積み終了先	1,144,000	7/15以降の残り所要積立額		
超過準備	1,144,000	積数		
非準備先残高	134,900	1日平均		
		200		
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,852,500	200		
準備預金進捗率	99.99% (実績)	96.67% (日数)		

《 7/15の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,530,400	前日比	34,800
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.06%台前半での出合いが中心となろう。

《 14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、前営業日比3兆3,000億円減の11兆5,000億円(当座預金残高見込みは1兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.063~0.065%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。財政等要因により大幅な不足日となった事から、やや強めに始まったものの、出合い一巡後は、閑散となり、そのまま本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が見られた程度であった。

《 14日のオープン市場動向 》  
 現先取引S/Nは落ち着いた水準での推移となった。短国市場は動意に乏しく、1Y物で0.02%の小額の出合いが見られた程度であった。CP発行市場はまとまった額の案件もなく、発行総額は700億円程度にとどまった。レート水準に特段の変化は見られなかった。

《 15日の材料 》  
 \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)  
 \*黒田日銀、総裁定例会見  
 \*経済・物価情勢の展望(中間評価)  
 \*米国5月の企業在庫 \*米国6月の小売売上高 \*英国6月の消費者物価指数

JGB新発10年債	0.540	0.005	日経平均株価(終値)	15,296.82	132.78	為替(9時)	101.36-37
						為替(5時)	101.47-48

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	7/7	7/8	7/9	7/10	7/11	7/14
日銀当預残	1,502,100	1,529,500	1,538,500	1,529,200	1,535,900	1,495,600
準備預金残	1,365,500	1,392,100	1,398,100	1,388,200	1,400,800	1,360,700
レート	0.065%	0.066%	0.066%	0.064%	0.065%	0.066%
月中平均	0.06543%	0.06550%	0.06556%	0.06540%	0.06531%	0.06536%

7/11のマネタリーベース				2,444,400	
7/11コール	合計	145,508	無担	50,195	有担
95,313					
コール前日増減	計	▲ 4,219	無担	▲ 3,936	有担
				▲ 283	

7/14の加重平均レート(速報)				7/11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		
0.050	~0.135 (0.066)	0.030	~0.040 (0.031)			O/N	0.030	~0.135 (0.065)	0.030	~0.040 (0.031)
0.065	~0.120 (0.077)					T/N			0.065	~0.120 (0.073)
						S/N				
0.117	~0.400 (0.166)					1W			0.075	~0.290 (0.086)
0.118	(0.118)					2W				
						3W				
0.118	~0.350 (0.123)			0.08-0.12	-	1M		0.075	~0.148 (0.098)	有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M				
				0.08-0.12	-	3M				
				-	0.0100	6M				
				-	0.0200	1Y				

《オペ情報、入札結果》

本日は日本銀行による調節はありませんでした。

「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