

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/7/15(火)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	15日需給速報 即日 金額	16日需給予想 金額	17日当社予想 金額
銀行券	900	300	0
財政	▲ 1,700	1,700	1,000
資金過不足	▲ 800	2,000	1,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)			
114,700			
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	▲ 400	▲ 300	
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	36,100	800	0
当預増減	35,300	2,800	1,000

当座預金残高	1,530,900	7/15以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,394,000		200
積み終了先	1,172,000	7/16以降の残り所要積立額	
超過準備	1,171,800	積数	1,907,100
非準備先残高	136,900	1日平均	61,500
積み期間(6/16～7/15)の所要準備額(積数)	1,852,500		
7月の新所要見込	61,500	(一日平均)	

7/14のマネタリーベース	2,402,800
7/14コール 合計	144,656 無担 49,326 有担 95,330
コール前日増減 計	▲ 852 無担 ▲ 869 有担 17

7/15 の加重平均レート(速報)				7/14 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	有担先日付分	
0.040 ～0.135 (0.065)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N 0.050 ～0.135 (0.066)		0.030 ～0.040 (0.031)		
0.063 ～0.120 (0.065)				T/N	0.065 ～0.120 (0.077)			
				S/N				
0.071 ～0.200 (0.100)				1W	0.117 ～0.400 (0.166)			
0.118 ～0.330 (0.153)				2W	0.118 (0.118)			
				3W				
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.118 ～0.350 (0.123)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.0240-0.0250	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

米ドル資金供給(固定金利方式) 7/17～7/24 (7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

《 7/16の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,533,700	前日比	2,800
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。

《 15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2兆6,000億円増の117兆1,000億円(当座預金残高見込みは153兆円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.063%前後での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。積み最終日であったものの、既にメドを付けていた先が多く、総じて軟調な展開となり、一巡後は0.06%の出合いも散見された。ターム物は、大手行から1M物0.118%でまとまった調達が見られた。

《 15日のオープン市場動向 》

現先取引S/Nは前日と同水準での推移となった。短国市場は3M物で0.025%のまとまった出合いが見られたものの、総じて見れば動意に乏しく、閑散であった。CP発行市場は鉄鋼・小売業態などからまとまった額の案件があり、発行総額は1,300億円に膨らんだ。レート水準は概ね横ばい圏であったが、一部では若干の上昇が見られた。

《 16日の材料 》

*日銀金融経済月報

*米国ページブック

*米国6月の生産者物価指数 *米国6月の鉱工業生産・設備稼働率

*国庫短期証券入札(1年、25,000億円、7/22発行)

*流動性供給入札(3,000億円、7/18発行)

《コール6月積み期間分の加重平均レート》

(土日を含む) 無担 0.06557% 有担 0.03907%

(営業日のみ) 無担 0.06550% 有担 0.03927%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.53-55
0.535 ▲ 0.005	15,395.16 98.34	為替(5時)	101.56-58

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	7/8	7/9	7/10	7/11	7/14	7/15
日銀当預残	1,529,500	1,538,500	1,529,200	1,535,900	1,495,600	1,530,900
準備預金残	1,392,100	1,398,100	1,388,200	1,400,800	1,360,700	1,394,000
レート	0.066%	0.066%	0.064%	0.065%	0.066%	0.065%
月中平均	0.06550%	0.06556%	0.06540%	0.06531%	0.06536%	0.06533%