

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/7/17(木) <セントラル短資株式会社>

<<資金需給>>

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想		22日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,200	▲ 1,300			2,000
財政		1,600	1,400	▲ 22,000		
資金過不足		400	100	▲ 20,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			11,700	4,000		
114,700			▲ 15,200	▲ 6,200		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						
国庫短期証売却						
国債買入					5,300	
CP等買入					3,300	
		▲ 600	▲ 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		▲ 200				
ETF買入				100		
国債補完供給						
小計		▲ 800	▲ 3,700	6,400		
当預増減		▲ 400	▲ 3,600	▲ 13,600		
当座預金残高	1,533,500	7/17以降の残り所要積立額				
準備預金残高	1,395,600	1,015,400				
積み終了先	755,800	7/18以降の残り所要積立額				
超過準備	573,500	積数 415,300				
非準備先残高	137,900	1日平均 14,300				
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	1,907,100					
準備預金進捗率	78.22% (実績)	6.45% (日数)				

<< 7/18の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,529,900	前日比	▲ 3,600
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%近辺での出合いが中心となるであろう。

<< 17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、117兆1,000億円(当座預金残高見込みは153兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは信託業態から0.061~0.062%、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。積みの序盤ではあるものの、地銀業態の調達ニーズが見られず、弱めの立ち上がりとなった。一巡後も地合いに変化はなく、0.06%での散発的な出合いが見られる程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物0.117%で調達を行った。

<< 17日のオープン市場動向 >>

現先取引S/Nは短国発行要因から若干上昇した。短国市場は3M物の入札が実施された。W I取引では0.01%台の出合いも確認されたが、落札結果は平均0.0206%、按分0.0263%と落ちついた結果であった。CP発行市場は20日にかかる取引となることから、鉄鋼・建設業態などからまとまった額の発行が見られ、発行総額は2,500億円程度に膨らんだ。レート水準は概ね横ばいであった。

<< 18日の材料 >>

- *日銀金融政策決定会合議事要旨(6月12、13日開催分)
- *米国7月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- *5年利付国債入札(27,000億円、7/23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	0.530	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	15,370.26	▲ 9.04	為替(9時)	101.64-65
						為替(5時)	101.49-51

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	7/10	7/11	7/14	7/15	7/16	7/17
日銀当預残	1,529,200	1,535,900	1,495,600	1,530,900	1,533,900	1,533,500
準備預金残	1,388,200	1,400,800	1,360,700	1,394,000	1,393,600	1,395,600
レート	0.064%	0.065%	0.066%	0.065%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06540%	0.06531%	0.06536%	0.06533%	0.06531%	0.06529%

7/16のマナターベース				2,440,000	
7/16コール合計	152,833	無担	56,018	有担	96,815
コール前日増減	計	2,652	無担	2,621	有担
					31

7/17の加重平均レート(速報)				7/16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	O/N	無担当日分		有担当日分	
0.055 ~ 0.135 (0.065)	0.030 ~ 0.040 (0.031)					0.055 ~ 0.135 (0.065)			0.030 ~ 0.040 (0.031)	
0.065 ~ 0.120 (0.085)							0.063 ~ 0.120 (0.067)			
0.071 ~ 0.117 (0.108)							1W		0.088 ~ 0.200 (0.101)	
							2W		0.118 ~ 0.330 (0.119)	
							3W			
0.245 (0.245)		0.08-0.12	-	-	-	0.118 (0.118)	1M		有担先日付分	
		0.08-0.12	-	-	-		2M			
0.100 (0.100)		0.08-0.12	0.0110-0.0250	3M			3M			
		-	-	6M			6M			
		-	0.0130-0.0160	1Y			1Y			

<< オペ情報、入札結果 >>

全店共通	8,000億円	7/22 ~ 10/20 (90日間) 応札	3,991億円	落札	3,991億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債買入	4,000億円	7/22 応札	12,203億円	落札	4,010億円	按分利回り較差	-0.004%	48.6%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	1,000億円	7/22 応札	3,990億円	落札	1,009億円	按分利回り較差	-0.003%	97.0%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	300億円	7/22 応札	1,515億円	落札	302億円	按分利回り較差	-0.015%	5.2%	平均利回り較差	-0.012%

T-Bill3M 応札21兆6,870億円 落札5兆2,137億5,000万円(非競争入札:4,762億円) 7/22~10/20 0.0263% 按分98.5333% 平均0.0206%

J-REIT買入 5億円 約定日7/17

「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録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