

2014/7/22(火)

<<セントラル短資株式会社>>

**<<資金需給>>**

単位 億円

	22日需給速報		23日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		700	▲100	0
財政		▲27,400	▲25,400	0
資金過不足		▲26,700	▲25,500	0
貸出			▲100	
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		4,000	9,700	
109,071		▲6,200	▲12,700	
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		5,500		5,200
CP等買入		3,300		
		▲300	▲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				
国債補完供給				
小計		6,300	26,800	5,200
当預増減		▲20,400	1,300	5,200

  

当座預金残高	1,509,700	7/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,373,300		141,100
積み終了先	1,134,500	7/23以降の残り所要積立額	
超過準備	1,126,700	積数	115,900
非準備先残高	136,400	1日平均	4,800
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	93.92% (実績)		22.58% (日数)

<< 7/23の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,511,000	前日比	1,300
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。

<< 22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115兆6,000億円(当座預金残高見込みは151兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.06~0.063%、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。出合いの中心は0.063%と先週末よりもやや弱めの立ち上がりとなった。一巡後は0.06~0.062%での出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られず、ロール案件での出合いが散見される程度であった。

<< 22日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nはレポレートの影響から小高く推移した。短国アウトライト市場は閑散状態で1Yが0.018-0.02%、3Mで0.02%の出合いが小額見られた程度であった。CP市場は鉄鋼・石油業態の大型案件を中心に1,300億円程度の発行となった。レートは概ね横ばい圏で推移した。

<< 23日の材料 >>  
 \*20年利付国債入札(12,000億円、7/25発行)  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、7/31借入)

<<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)	
0.540	0.000	15,343.28	127.57	101.42-44	
				為替(5時)	101.49-50

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	7/14	7/15	7/16	7/17	7/18	7/22
日銀当預残	1,495,600	1,530,900	1,533,900	1,533,500	1,530,100	1,509,700
準備預金残	1,360,700	1,394,000	1,393,600	1,395,600	1,400,200	1,373,300
レート	0.066%	0.065%	0.065%	0.065%	0.068%	0.066%
月中平均	0.06536%	0.06533%	0.06531%	0.06529%	0.06581%	0.06582%

7/18のマネタリーベース			
		2,438,800	
7/18コール	合計	163,637	無担 66,763 有担 96,874
コール前日増減	計	5,437	無担 4,756 有担 681

7/22の加重平均レート(速報)				7/18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	無担先日付分	有担当日分	
0.050 ~0.135 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.135 (0.068)		0.065 ~0.125 (0.091)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.120 (0.073)				T/N				
				S/N				
0.071 ~0.200 (0.118)				1W		0.089 ~0.400 (0.113)		
				2W		0.118 (0.118)		
				3W				
		0.08-0.12	-	1M		0.150 (0.150)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.0200	3M		0.120 (0.120)		
		-	-	6M				
		-	0.018-0.020	1Y				

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	2,000億円	7/22	~ 7/23 (1日間)	応札	30億円	落札	30億円	-0.400%	全取	平均	-0.400%(即)
国債買入	3,000億円	7/24		応札	14,129億円	落札	3,000億円	全取利回り較差	0.008%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	2,000億円	7/24		応札	10,279億円	落札	2,005億円	按分利回り較差	0.003%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	200億円	7/24		応札	570億円	落札	200億円	按分価格較差	-0.16円	平均価格較差	-0.251円
米ドル資金供給(固定金利方式)		7/24~7/31 (7日間)		応札なし				貸付利率	0.570%		

「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