

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/7/25(金) <セントラル短資株式会社>

## <<資金需給>>

単位 億円

	25日需給速報	28日需給予想	29日当社予想
	即日金額	金額	金額
銀行券	▲ 1,100	500	0
財政	▲ 8,600	▲ 16,000	▲ 3,000
資金過不足	▲ 9,700	▲ 15,500	▲ 3,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)	10,100	4,000	10,100
104,441	▲ 11,800	▲ 6,000	▲ 7,900
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		5,600	
CP等買入	▲ 500	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488			
被災地支援	1,100		
3,623	▲ 1,300		
社債等買入	▲ 200		
ETF買入		100	
国債補完供給	▲ 100	100	
即日			
小計	▲ 2,700	3,400	32,200
当預増減	▲ 12,400	▲ 12,100	29,200

当座預金残高	1,499,000	7/25以降の残り所要積立額
準備預金残高	1,374,400	88,100
積み終了先	1,144,700	7/28以降の残り所要積立額
超過準備	1,142,700	積数
非準備先残高	124,600	1日平均
		2,800
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	97.25% (実績)	38.71% (日数)

7/24のマネタリーベース		2,420,700	
7/24コール	合計	166,060	無担 69,801 有担 96,259
コール前日増減	計	390	無担 424 有担 ▲ 34

7/25 の加重平均レート(速報)			7/24 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 (0.070)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.045 ~0.135 (0.067)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.063 ~0.120 (0.078)					0.065 ~0.120 (0.082)			
					0.121 (0.121)			
0.117 (0.117)					0.117 (0.117)			
					0.118 ~0.340 (0.125)			
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-		0.118 (0.118)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	0.030-0.040		0.260 ~0.400 (0.353)			
		-	-					
		-	-					
		-	-					

## <<オペ情報、入札結果>>

全店共通	10,000億円	7/29 ~ 11/7 (101日間)	応札 10,060億円	落札 10,060億円	0.100%	全取	平均 0.100% (固定)
国債補完	2,000億円	7/25 ~ 7/28 (3日間)	応札 49億円	落札 49億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
CP買入	4,000億円	7/30	応札 8,205億円	落札 3,876億円	按分レート	0.088%	75.4% 平均落札レート 0.091%
国短買入	30,000億円	7/29	応札 71,504億円	落札 30,001億円	按分利回り較差	0.004%	80.1% 平均利回り較差 0.005%
流動性供給	応札 1兆5,174億円	落札 3,999億円	7/29 募入最大利回り較差 ▲0.008%	按分 97.4730%	募入平均利回り較差 ▲0.008%		
J-REIT買入	5億円	約定日 7/25					

「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。」

<< 7/28の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,486,900	前日比	▲ 12,100
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%近辺での出合いが中心と見込みである。					

<< 25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、114兆9,000億円(当座預金残高見込みは149兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは信託業態から0.067~0.068%、地銀業態から0.066~0.067%、大手行からは0.065%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.067~0.068%とやや強めの立ち上がりとなった。一巡後も朝方の地合いを引き継ぎ、0.068%近辺での出合いが中心のまま、週末の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物0.117%、2W、1M物0.118%で調達を行った。

<< 25日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは引き続き小高く推移した。短国アウトライイト市場は短国買入オペが実施され、平均利回較差+0.005%、按分利回較差+0.004%と既発債の処分ニーズからやや軟調な結果となった。CP市場は閑散で、発行総額は230億円にとどまった。CP等買入オペは応札可能銘柄が前回対比で少額だったことから、平均落札レート0.091%、按分落札レート0.088%と小幅低下の結果となった。

<< 28日の材料 >>  
 \*特になし

JGB新発10年債	0.530	0.010	日経平均株価(終値)	15,457.87	173.45	為替(9時)	101.76-77
						為替(5時)	101.89-91

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	7/17	7/18	7/22	7/23	7/24	7/25
日銀当預残	1,533,500	1,530,100	1,509,700	1,510,800	1,511,400	1,499,000
準備預金残	1,395,600	1,400,200	1,373,300	1,383,900	1,381,200	1,374,400
レート	0.065%	0.068%	0.066%	0.067%	0.067%	0.070%
月中平均	0.06529%	0.06581%	0.06582%	0.06587%	0.06592%	0.06637%

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