

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/8/6(水)

◀セントラル短資株式会社▶

## ◀資金需給▶

単位 億円

	6日需給速報		7日需給予想		8日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		900	▲ 400			0
財政		▲ 1,400	▲ 26,900	▲ 3,000		
資金過不足		▲ 500	▲ 27,300	▲ 3,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
105,038						
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		6,400				5,300
CP等買入						4,300
貸出支援基金(成長)						
34,837(増加)						
133,488						
被災地支援						
3,623						
社債等買入				▲ 200		
ETF買入		100		100		
国債補完供給						
小計		6,400		▲ 700		9,600
当預増減		5,900		▲ 28,000		6,600

当座預金残高	1,530,700	8/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,399,800		11,000
積み終了先	1,188,700	8/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,188,600	積数	9,300
非準預先残高	130,900	1日平均	1,000
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)			1,905,400
準備預金進捗率	99.51% (実績)		70.97% (日数)

8/5のマネタリーベース		2,434,300	
8/5コール合計	164,716	無担	68,273
		有担	96,443
コール前日増減	計	▲ 413	無担
			334
			有担
			▲ 747

8/6の加重平均レート(速報)				8/5の加重平均レート(確報)							
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	
0.045	~0.135 (0.069)	0.030	~0.040 (0.031)			0.045	~0.135 (0.072)			0.030	~0.040 (0.031)
0.062	~0.120 (0.072)							0.062	~0.130 (0.080)		
0.117	~0.130 (0.124)							0.071	~0.200 (0.099)		
0.116	~0.170 (0.135)							0.115	~0.118 (0.117)		
								0.116	(0.116)		
0.118	(0.118)			0.08-0.12	-	1M		0.118	(0.118)		有担先日付分
0.121	(0.121)			0.08-0.12	-	2M					
				0.08-0.12	0.02-0.021	3M					
				-	0.012-0.0199	6M					
				-	-	1Y					

## ◀オペ情報、入札結果▶

国債買入	4,000億円	8/8	応札	8,717億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	-0.004%	96.5%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	1,000億円	8/8	応札	3,818億円	落札	1,004億円	按分利回り較差	-0.002%	78.0%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	300億円	8/8	応札	1,676億円	落札	300億円	全取利回り較差	0.001%		平均利回り較差	0.002%
T-Bill6M	応札21兆2,024億円	落札3兆2,178億8,000万円(非競争入札:2,821億円)	8/11~2015/2/10	0.0199%	按分	19.0877%	平均	0.0159%			
ETF買入	156億円	約定日	8/6								
J-REIT買入	5億円	約定日	8/6								

「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。」

◀ 8/7の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,502,700	前日比	▲ 28,000
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.06~0.065%中心の取引となろう。

## ◀ 6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2,000億円増加の119兆3,000億円(当座預金残高見込みは153兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.061~0.064%、大手行から0.06%付近のビッドで始まり、落ち着いた立ち上がりとなった。その後、一部邦銀から試し取りと思われるビッドが入り、0.12%を超える水準での出会いも見られた。その他の出会いは、0.06~0.063%中心に移した。午後の出会いは調整程度で一日の取引を終えた。ターム物については、大手行が1W物0.117%、2W・1M物0.118%での調達を行った。

## ◀ 6日のオープン市場動向 ▶

現先レートは横ばい圏で推移した。短国市場は6M物の入札が実施された。WIでの出会いが観測されない中、平均落札利回0.0159%、最高落札利回0.0199%と強めの決着となった。セカンダリーでは、0.012%まで買い進まれる場面も見られた。CP市場は電機、ゼネコン、鉄鋼業態などからの発行が見られ、発行総額は1,700億円程度となった。発行レートは概ね横ばいながらも、一部の銘柄では若干のレート上昇も見られた。

## ◀ 7日の材料 ▶

- \*7月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、8日まで)
- \*MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
- \*ECB定例理事会(金融政策発表あり)
- \*米国6月の消費者信用残高
- \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、8/11発行)
- \*流動性供給入札(3,000億円、8/11発行)

JGB新発10年債	0.520	0.005	日経平均株価(終値)	15,159.79	▲ 160.52	為替(9時)	102.59-61
						為替(5時)	102.51-52

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	7/30	7/31	8/1	8/4	8/5	8/6
日銀当預残	1,526,800	1,520,600	1,527,700	1,482,800	1,524,800	1,530,700
準備預金残	1,389,700	1,389,500	1,399,900	1,356,700	1,399,600	1,399,800
レート	0.065%	0.065%	0.068%	0.067%	0.072%	0.069%
月中平均	0.06630%	0.06626%	0.06800%	0.06775%	0.06860%	0.06867%

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