

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/1/14(水)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	14日需給速報	15日需給予想	16日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	3,600	2,100	2,000
財政	▲ 22,000	▲ 18,800	▲ 6,000
資金過不足	▲ 18,400	▲ 16,700	▲ 4,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)			
78,040			
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	12,200	4,700	
CP等買入	▲ 100	3,500	
		▲ 500	
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789			
被災地支援			
3,251			
社債等買入			
ETF買入		100	
国債補完供給	即日 ▲ 100		
	300	100	
小計	12,300	37,900	0
当預増減	▲ 6,100	21,200	▲ 4,000

当座預金残高	1,792,100	1/14以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,638,300		1,800
積み終了先	1,333,500	1/15以降の残り所要積立額	
超過準備	1,333,500	積数	500
非準預先残高	153,800	1日平均	500
積み期間(12/16～1/15)の所要準備額(積数)			1,977,100
準備預金進捗率	99.97%	(実績)	96.77% (日数)

1/13のマネタリーベース	2,745,300
1/13コール 合計	205,035 無担 84,462 有担 120,573
コール前日増減 計	4,225 無担 ▲ 811 有担 5,036

1/14 の加重平均レート(速報)					1/13 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 ~0.080 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.125 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.075 ~0.120 (0.079)				T/N		0.073 ~0.120 (0.083)	
0.125 (0.125)				S/N			
0.117 (0.117)				1W		0.117 (0.117)	
0.083 ~0.118 (0.090)				2W		0.118 (0.118)	
				3W			
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M		0.118 ~0.225 (0.134)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.055	3M		0.118 (0.118)	
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

《オペ情報、入札結果》

国債補完 5,462億円 1/14 ～ 1/15 (1日間) 応札 72億円 落札 72億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 国債補完 6,000億円 1/14 ～ 1/15 (1日間) 応札 4億円 落札 4億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

30年利付国債(表面利率1.5%) 応札2兆2,947億円 落札6,432億円(I 非競争入札:563億円) 1/16～2044/12/20 1.131% 按分32.8638% 平均1.123%

交付税特会 1兆500億円 1/22～7/24 応札 3兆2,400億円 落札 1兆500億200万円 0.090% 按分 46.6670% 平均 0.088%

ETF買入 341億円 約定日 1/14

「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

1/15の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,813,300	前日比	21,200
O/N	0.06～0.08	T/N	0.06～0.12	S/N	0.06～0.12
無担O/Nは0.07%程度の出合いが中心になると見込まれる。					

《 14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、132兆9,000億円(当座預金残高見込みは179兆円)。朝方の無担O/Nは、大手行から0.068～0.07%程度、地銀・信託業態から0.07～0.075%の調達希望で始まった。その後も、0.07～0.075%中心で推移し、一日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W 0.117%、2W・1M0.118%で調達を行った。

《 14日のオープン市場動向 》

現先レートは横ばい圏での推移となった。短国市場は動意に乏しく閑散とした中、3M物で▲0.055%での出合いが見られた程度であった。C P市場は、電機・鉄鋼業態を中心に発行案件が見られ、発行総額は1,400億円弱となった。発行レートは横ばいであった。

《 15日の材料 》

*日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)

*11月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+5.0%)

*11月の特定サービス産業動態統計速報 *12月の企業物価指数

*米国12月の生産者物価指数

*国庫短期証券入札(3ヵ月、57,000億円、1/19発行)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	117.81-84
0.250 ▲ 0.015	16,795.96 ▲ 291.75	為替(5時)	117.08-09

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	1/6	1/7	1/8	1/9	1/13	1/14
日銀当預残	1,807,600	1,799,200	1,769,300	1,811,100	1,798,200	1,792,100
準備預金残	1,639,600	1,641,500	1,616,700	1,648,800	1,642,100	1,638,300
レート	0.071%	0.073%	0.074%	0.075%	0.074%	0.073%
月中平均	0.06750%	0.06829%	0.06900%	0.07100%	0.07123%	0.07136%