

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/7/21(火) <セントラル短資株式会社>

## <<資金需給>>

単位 億円

	21日需給速報		22日需給予想	23日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		800	▲ 200	0
財政		▲ 56,000	4,000	0
資金過不足		▲ 55,200	3,800	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,000		
65,743		▲ 1,300		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			25,000	
国庫短期証売却				
国債買入			11,900	4,700
CP等買入			4,000	
		▲ 600	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援				
3,241				
社債等買入				
ETF買入		300	300	
国債補充供給		▲ 100	100	
小計		▲ 700	41,100	4,700
当預増減		▲ 55,900	44,900	4,700

当座預金残高	2,221,100	7/21以降の残り所要積立額
準備預金残高	2,012,700	67,900
積み終了先	1,665,100	7/22以降の残り所要積立額
超過準備	1,663,900	積数
非準預先残高	208,400	1日平均
		2,200
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	2,021,900	
準備預金進捗率	97.34% (実績)	19.35% (日数)

7/17のマナタリーベース		3,229,700	
7/17コール	合計	195,679	無担 62,410 有担 133,269
コール前日増減	計	▲ 1,285	無担 ▲ 516 有担 ▲ 769

7/21の加重平均レート(速報)				7/17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		有担当日分	
0.060	~0.125 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)			O/N	0.020 ~0.080 (0.074)	0.030	~0.040 (0.031)
0.050	~0.120 (0.075)					T/N		0.068	~0.120 (0.077)
						S/N			
0.073	~0.130 (0.115)					1W		0.130	(0.130)
						2W	0.118	(0.118)	0.115 ~0.340 (0.134)
						3W			
0.170	(0.170)			0.08-0.13	-	1M		0.280	(0.280)
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	▲0.002	3M		0.080	(0.080)
				-	-	6M			
				-	▲0.019	1Y			

## <<オペ情報、入札結果>>

国債補完	24,000億円	7/21	~ 7/22 (1日間)	応札	50億円	落札	50億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債補完	4,000億円	7/21	~ 7/22 (1日間)	応札	1億円	落札	1億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	700億円	7/23	応札	3,783億円	落札	703億円	按分利回り較差	0.005%	21.2%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	7/23	応札	18,207億円	落札	4,009億円	按分利回り較差	0.003%	21.5%	平均利回り較差	0.004%
米ドル資金供給(固定金利方式)		7/23~7/30 (7日間)	応札	100万ドル	落札	100万ドル	貸付利率	0.630%			
J-REIT買入	14億円	約定日	7/21								

「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

<< 7/22の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,266,000	前日比	44,900
O/N	0.065~0.075	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.065~0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

### << 21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4兆6,000億円減少の167兆6,000億円(当座預金残高見込みは222兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀・地銀・信託業態から0.06~0.075%近辺の調達希望で始まった。全体的に先週とほぼ変わらない地合いで、立ち上がりは0.075%近辺の出合いが中心。まとまった金額の取引に関しては0.07%台後半の出合いも散見されたが、一巡後は取り下がり、0.07%前後の出合いで推移した。ターム物は、大手行から1Wの期間でまとまった調達が見られた。

### << 21日のオープン市場動向 >>

短国現先レートS/Nは低位横ばい圏で推移した。短国アウトライイト市場では3M:▲0.002%、1Y:▲0.019%の出合いが見られたが、動意に乏しく総じて閑散であった。CP市場は精密機器、ノンバンク業態等からのまとまった発行案件がみられ、償還総額1,200億円に対し、発行総額はほぼ同額の1,300億円程度となった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

### << 22日の材料 >>

- \*米国6月の中古住宅販売
- \*20年利付国債入札(12,000億円、7/24発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、7/30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	0.07193%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07100%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	0.416	▲ 0.004	日経平均株価(終値)	20,841.97	191.05	為替(9時)	124.29-31
						為替(5時)	124.38-39

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	7/13	7/14	7/15	7/16	7/17	7/21
日銀当預残	2,270,100	2,272,600	2,275,400	2,273,700	2,277,000	2,221,100
準備預金残	2,056,600	2,065,000	2,062,700	2,056,700	2,060,800	2,012,700
レート	0.075%	0.076%	0.076%	0.075%	0.074%	0.076%
月中平均	0.07400%	0.07414%	0.07427%	0.07431%	0.07425%	0.07433%