

2014/7/28(月)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	28日需給速報 即日 金額	29日需給予想 金額	30日当社予想 金額
銀行券	400	▲ 400	▲ 1,000
財政	▲ 17,200	▲ 4,400	2,000
資金過不足	▲ 16,800	▲ 4,800	1,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)	4,000	10,100	
102,431	▲ 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		9,000
CP等買入	▲ 400	▲ 200	3,900
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		▲ 100	
ETF買入	100		
国債補完供給	100		
小計	3,400	31,900	12,900
当預増減	▲ 13,400	27,100	13,900

当座預金残高	1,485,600	7/28以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,360,600		52,400
積み終了先	1,135,100	7/29以降の残り所要積立額	
超過準備	1,132,100	積数	44,200
非準備先残高	125,000	1日平均	2,500
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	97.68%	(実績)	41.94% (日数)

7/25のマネタリーベース	2,409,500
7/25コール 合計	168,634 無担 71,474 有担 97,160
コール前日増減 計	2,574 無担 1,673 有担 901

7/28 の加重平均レート(速報)				7/25 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		
0.055 ~0.080 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.135 (0.070)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.065 ~0.120 (0.076)				T/N	0.063 ~0.120 (0.078)			
				S/N				
0.117 ~0.400 (0.121)				1W	0.117 (0.117)			
0.118 ~0.280 (0.168)				2W	0.118 (0.118)			
				3W				
0.118 ~0.145 (0.125)		0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.0320	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債買入	3,000億円	7/30	応札	13,840億円	落札	3,006億円	按分利回り較差	0.008%	46.4%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	2,000億円	7/30	応札	11,710億円	落札	2,003億円	按分利回り較差	0.004%	58.2%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	7/30	応札	15,202億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.005%	19.5%	平均利回り較差	-0.004%

「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

《 7/29の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,512,700	前日比	27,100
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12
無担O/Nは0.06~0.065%近辺での出合いが中心となるであろう。					

《 28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、114兆3,000億円(当座預金残高見込みは148兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.063~0.064%、大手行からは0.06%付近での調達希望で始まった。出合いの中心は0.065%前後となり、一巡後もさほど調達レートは低下せず、0.063%近辺での出合いで推移しつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物0.117%で調達を行った。

《 28日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは0.08%程度で、やや高止まりの印象となった。短国アウトライト市場は3M:0.032%の出合いが見られたものの、オペや入札等のイベントが無く閑散で、出合い自体は限られていた。CP市場は大口の発行案件や月末の前倒し発行の影響で、発行総額は4,000億円程度となった。現先レートの高止まりも影響し、短い期間の物では発行レートが上昇気味となっていた。

《 29日の材料 》

*6月の完全失業率(市場予想: 3.5%)

*6月の有効求人倍率(市場予想: 1.09倍)

*6月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比▲3.8%)

*6月の商業販売統計速報

*石田日銀審議委員、山口県金融経済懇談会にて講演

*米国FOMC(1日目)

*米国5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数

*米国7月のCB消費者信頼感指数

*2年利付国債入札(27,000億円、8/15発行)

JGB新発10年債	0.525	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	15,529.40	71.53	為替(9時)	101.75-76
						為替(5時)	101.87-88

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	7/18	7/22	7/23	7/24	7/25	7/28
日銀当預残	1,530,100	1,509,700	1,510,800	1,511,400	1,499,000	1,485,600
準備預金残	1,400,200	1,373,300	1,383,900	1,381,200	1,374,400	1,360,600
レート	0.068%	0.066%	0.067%	0.067%	0.070%	0.066%
月中平均	0.06581%	0.06582%	0.06587%	0.06592%	0.06637%	0.06636%