

2014/7/29(火)

<セントラル短資株式会社>

<<資金需給>>

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想		31日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 300	▲ 1,100		
財政		▲ 3,400	400	1,900		
資金過不足		▲ 3,800	100	800		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		10,100				
104,598		▲ 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			9,100			
CP等買入			3,900			
		▲ 200	▲ 100			
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	▲ 100			
ETF買入						
国債補完供給						
小計		31,900	12,800	0		
当預増減		28,100	12,900	800		

当座預金残高	1,513,700	7/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,386,900		44,200
積み終了先	1,167,100	7/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,167,100	積数	39,800
非準備先残高	126,800	1日平均	2,300
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	97.91% (実績)		45.16% (日数)

7/28のマネタリーベース		2,395,700	
7/28コール	合計	174,064	無担 78,075 有担 95,989
コール前日増減	計	5,430	無担 6,601 有担 ▲ 1,171

7/29 の加重平均レート(速報)			7/28 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 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.080 (0.066)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.065 ~0.130 (0.099)					0.065 ~0.120 (0.076)	
0.071 ~0.200 (0.119)					0.117 ~0.400 (0.120)	
0.170 ~0.330 (0.197)					0.118 ~0.280 (0.168)	
0.090 (0.090)		0.08-0.12	-		0.118 ~0.145 (0.125)	有担先日付分
0.117 (0.117)		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	0.032-0.0325			
		-	-			
		-	-			
		-	-			

<<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 7/31~8/7 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.560%  
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札 14兆6,542億円 落札 2兆4,679億円(I 非競争入札:2,288億円) 8/15~2016/8/15 0.067% 按分78.5736% 平均0.066%

「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

<< 7/30の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,526,600	前日比	12,900
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。

<< 29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、117兆4,000億円(当座預金残高見込みは151兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀・信託業態から0.062~0.063%、大手行からは0.06%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.063~0.064%となった。一巡後はレートをやや切り下げ、0.06%近辺での出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いはなく、ロール案件での取引が散見される程度であった。

<< 29日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは0.025~0.04%程度となり、前日比で低下した。短国アウトライト市場は3M:0.032~0.0325%の出合いが見られた。前日から横ばい圏のレート水準で、閑散との印象であった。CP市場は月末発行にあたり、発行総額は8,600億円程度まで膨らんだ。CP現先のレートが下がっていないこともあり、発行レートは引き続き強含みで推移した。

<< 30日の材料 >>  
 \*6月の鉱工業生産・出荷・在庫速報  
 \*米国FOMC(2日目)  
 \*米国4-6月期のGDP速報値  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、8/7発行)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.83-84
0.525	0.000	15,618.07	88.67
		為替(5時)	101.90-91

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	7/22	7/23	7/24	7/25	7/28	7/29
日銀当預残	1,509,700	1,510,800	1,511,400	1,499,000	1,485,600	1,513,700
準備預金残	1,373,300	1,383,900	1,381,200	1,374,400	1,360,600	1,386,900
レート	0.066%	0.067%	0.067%	0.070%	0.066%	0.066%
月中平均	0.06582%	0.06587%	0.06592%	0.06637%	0.06636%	0.06634%