

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/8/1(金)

<<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	1日需給速報		4日需給予想		5日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 500		1,300		2,000
財政		▲ 1,300		▲ 42,200		1,000
資金過不足		▲ 1,800		▲ 40,900		3,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		12,900		2,900		
107,048		▲ 10,400		▲ 4,900		
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		6,400				5,100
CP等買入						
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						
ETF買入						
国債補完供給						
小計		8,900		▲ 2,000		35,100
当預増減		7,100		▲ 42,900		38,100
当座預金残高	1,527,700	8/1以降の残り所要積立額				
準備預金残高	1,399,900	30,000				
積み終了先	1,183,600	8/4以降の残り所要積立額				
超過準備	1,181,900	積数				
非準備先残高	127,800	1日平均				
		1,300				
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	99.18%	(実績)	61.29%	(日数)		

<< 8/4の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,484,800	前日比	▲ 42,900
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%中心の取引となろう。					

<< 1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1兆2,000億円増加の118兆5,000億円(当座預金残高見込みは152兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.065~0.068%、大手行からは0.065%での調達希望で始まった。週末を挟む取引となったことで、昨日より強めの立ち上がりとなった。一巡後の取引は、0.065~0.066%中心に底堅く推移した。午後は調整程度の出合いに終始しつつ、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。

<< 1日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは0.05%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:0.025~0.028%の出合いが見られた。短国買入オペが3兆円でオフアーされ、按分利回較差0.00%、平均利回較差+0.002%、按分比率53.4%という結果になった。オフアー額、結果共に事前の予想範囲内で、市場に与える影響は限定的であった。CP市場は発行総額1,800億円程度となった。5日発行にあたり、ノンバンク・鉄鋼・電機業態等の大型発行案件が見られた。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなっていた。

<< 4日の材料 >>  
 \*8月の日銀当座預金増減要因見込み  
 \*7月のマネタリーベース

<< コール7月の加重平均レート >>			
(土日を含む)	無担	0.06626%	有担 0.03397%
(営業日のみ)	無担	0.06582%	有担 0.03427%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)		102.77-78	
0.530	0.000	15,523.11	▲ 97.66	為替(5時)		102.94-96	

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	7/25	7/28	7/29	7/30	7/31	8/1
日銀当預残	1,499,000	1,485,600	1,513,700	1,526,800	1,520,600	1,527,700
準備預金残	1,374,400	1,360,600	1,386,900	1,389,700	1,389,500	1,399,900
レート	0.070%	0.066%	0.066%	0.065%	0.065%	0.068%
月中平均	0.06637%	0.06636%	0.06634%	0.06630%	0.06626%	0.06800%

7/31のマネタリーベース				2,431,900	
7/31コール	合計	167,920	無担	68,502	有担 99,418
コール前日増減	計	▲ 11,190	無担	▲ 10,475	有担 ▲ 715

8/1の加重平均レート(速報)				7/31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 ~0.135 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)				O/N 0.050 ~0.135 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.062 ~0.120 (0.075)						T/N		0.065 ~0.122 (0.077)	
						S/N			
0.117 (0.117)						1W		0.117 (0.117)	
0.118 (0.118)						2W		0.118 (0.118)	
						3W			
0.090 ~0.145 (0.114)				0.08-0.12	-	1M		0.118 ~0.145 (0.119)	
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	0.025-0.028	3M		0.265 (0.265)	
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

## <<オペ情報、入札結果>>

国短買入	30,000億円	8/5	応札	42,912億円	落札	30,004億円	按分利回り較差	0.000%	53.4%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	1,100億円	8/5	応札	5,756億円	落札	1,100億円	按分利回り較差	0.016%	84.0%	平均利回り較差	0.017%
国債買入	4,000億円	8/5	応札	16,817億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	-0.003%	46.7%	平均利回り較差	-0.003%
ETF買入	144億円	約定日 8/1									

「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