CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/8/20(水)　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	20日需給速報		21日需給予想	22日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	▲ 1,300	▲ 2,000
財政		▲ 16,500	▲ 13,700	2,000
資金過不足		▲ 16,400	▲ 15,000	0
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 105,069				
国債買現 0				
CP買現 0				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入				6,300
CP等買入		▲ 600	4,400 ▲ 500	
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		▲ 600	3,900	6,300
当預増減		▲ 17,000	▲ 11,100	6,300

当座預金残高	1,511,200	8/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,372,000		231,500
積み終了先	1,109,800	8/21以降の残り所要積立額	
超過準備	1,101,800	積数	183,300
非準預先残高	139,200	1日平均	7,000
積み期間(8/16～9/15)の所要準備額(積数)			1,901,100

準備預金進捗率　90.36%　(実績)　16.13%　(日数)

8/19のマネタリーベース						2,437,000
8/19コール	合計	168,887	無担	73,095	有担	95,792
コール前日増減	計	2,349	無担	1,855	有担	494

≪ 8/21の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	1,500,100	前日比	▲ 11,100
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%程度での出合いが中心になると見込まれる。

≪ 20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2兆円減少の115兆円(当座預金残高見込みは151兆1,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは大手行から0.06%、地銀・信託・証券業態から0.064～0.065%前後の調達希望で始まった。一部業態より0.125%で少額の試し取りが行われたものの、一巡後は0.062～0.063%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関してはロール案件による出合いが散見された程度であった。

≪ 20日のオープン市場動向 ≫

現先レートS/Nは昨日と水準に大きな変化がなく、横ばい圏で推移した。短国アウトライトは、2M:0.0325%、3M:0.025～0.028%、1Y:0.015～0.016%と引き続き低水準で推移した。CP市場は、機械業態のまとまった金額の調達以外に目立った発行が無く、発行総額は900億円弱に止まった。発行レートは、0.10%を中心に概ね横ばい圏であった。

≪ 21日の材料 ≫

*7月の米中古住宅販売
*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、8/25発行)
*流動性供給入札(4,000億円、8/25発行)

≪コール7月積み期間分の加重平均レート≫

(土日を含む)	無担	0.06761%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06727%	有担	0.03100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	102.94-95
0.510	0.010	15,454.45	4.66	為替(5時)	103.29-30

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	8/13	8/14	8/15	8/18	8/19	8/20
日銀当預残	1,500,100	1,494,600	1,536,100	1,498,600	1,528,200	1,511,200
準備預金残	1,370,400	1,369,400	1,399,800	1,363,600	1,392,100	1,372,000
レート	0.067%	0.068%	0.068%	0.066%	0.067%	0.073%
月中平均	0.06815%	0.06814%	0.06812%	0.06800%	0.06795%	0.06820%

8/20 の加重平均レート(速報)					8/19 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 ～0.135 (0.073)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N	0.040 ～0.135 (0.067)		0.030 ～0.040 (0.031)	
0.065 ～0.120 (0.086)				T/N		0.065 ～0.120 (0.078)		
				S/N				
0.116 ～0.145 (0.128)				1W		0.071 ～0.117 (0.107)		
				2W		0.118 (0.118)		
0.075 (0.075)				3W		0.115 (0.115)		
0.118 ～0.280 (0.133)		0.08-0.12	-	1M		0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.12	0.0325	2M				
		0.08-0.12	0.025-0.028	3M				
		-	-	6M				
		-	0.015-0.016	1Y				

≪オペ情報、入札結果≫

国債買入	3,000億円	8/22	応札	16,986億円	落札	3,003億円	按分利回り較差	0.005%	20.5%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	2,000億円	8/22	応札	10,415億円	落札	2,001億円	按分利回り較差	0.004%	54.8%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	1,000億円	8/22	応札	3,096億円	落札	1,005億円	按分利回り較差	0.007%	84.1%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	300億円	8/22	応札	1,318億円	落札	302億円	按分利回り較差	0.002%	15.4%	平均利回り較差	0.003%

「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