

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/4/16(水) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	16日需給速報		17日需給予想		18日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 1,000	▲ 2,000		
財政		2,600	▲ 25,400	1,000		
資金過不足		2,500	▲ 26,400	▲ 1,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			3,300	7,900		
127,928			▲ 1,700	▲ 10,200		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入		15,000				
国庫短期証売却						
国債買入		3,100		9,000		
CP等買入						
		▲ 500	▲ 300			
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512						
被災地支援						
3,805						
社債等買入			900			
ETF買入		100				
国債補完供給						
小計		17,700	2,200	6,700		
当預増減		20,200	▲ 24,200	5,700		
当座預金残高	1,339,600	4/16以降の残り所要積立額				
準備預金残高	1,213,500	1,842,000				
積み終了先	297,000	4/17以降の残り所要積立額				
超過準備	227,900	積数 1,047,400				
非準備先残高	126,100	1日平均 36,100				
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,842,000					
準備預金進捗率	43.14%	(実績)		3.33%	(日数)	

<< 4/17の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,315,400	前日比	▲ 24,200
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.06%近辺での出合いが中心となるであろう。

### << 16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は、102兆7,000億円。無担O/Nは地銀、信託業態から0.06~0.065%、都銀からは0.06%近辺での調達希望。積み目の初日を迎えたが、出合いの中心は0.06%と昨日と同様落ち着いた立ち上がりとなった。一巡後も0.06%近辺での出合いが散見される程度で、本日の取引を終了した。ターム物に関しては、大手行が1W物0.117%で調達を行った。

### << 16日のオープン市場動向 >>

現先レートは前日比小幅低下となったものの、水準としては小高く推移。短国市場は1Y物の入札が実施された。WI取引では0.043~0.045%が見られる中、平均落札利回0.0401%、按分落札利回0.0431%の結果となり、強めの決着となった。セカンダリーではショートカバーから0.025%の出合いも見られた。CP市場は1,700億円程度の発行。レートは概ね横ばい圏ながら足元金利の高止まりを受け、最上格銘柄のショートターム物では小幅上昇となった。

### << 17日の材料 >>

- \*地域経済報告(さくらレポート)
- \*月例経済報告
- \*3月の消費動向調査
- \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、4/21発行)
- \*20年利付国債入札(12,000億円、4/21発行)

<<コール3月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06768%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06714%	有担 0.04100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.605	0.005	14,417.68	420.87	101.87-89	102.21-23

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	4/9	4/10	4/11	4/14	4/15	4/16
日銀当預残	1,305,900	1,300,200	1,301,500	1,301,100	1,319,400	1,339,600
準備預金残	1,188,900	1,183,300	1,183,000	1,187,200	1,217,600	1,213,500
レート	0.064%	0.065%	0.065%	0.065%	0.064%	0.064%
月中平均	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06493%	0.06488%

4/15のマナターベース				2,220,000		
4/15コール	合計	142,123	無担	42,407	有担	99,716
コール前日増減	計	527	無担	▲ 1,712	有担	2,239

  

4/16の加重平均レート(速報)				4/15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 ~0.080 (0.064)	0.040	~0.050	(0.041)					O/N	0.050 ~0.145 (0.064)		
0.060 ~0.125 (0.088)						T/N		0.060	~0.125 (0.090)		
						S/N					
0.117 ~0.130 (0.117)						1W	0.170	(0.170)	0.117	~0.200 (0.145)	
0.330 (0.330)						2W			0.116	~0.118 (0.118)	
						3W					
0.090 ~0.250 (0.127)				0.08-0.13	-	1M			0.245	(0.245)	有担先日付分
				0.08-0.13	-	2M					
				0.08-0.13	-	3M					
				-	-	6M					
				-	-	1Y					

## <<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	4/18	~ 7/29 (102日間)	応札	7,893億円	落札	7,893億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	2,500億円	4/18	応札	11,726億円	落札	2,506億円	按分利回り較差	0.002%	1.0%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,500億円	4/18	応札	12,980億円	落札	2,508億円	按分利回り較差	0.003%	15.9%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	4/18	応札	15,405億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	0.005%	64.8%	平均利回り較差	0.006%
T-Bill1Y	応札12兆8,352億円	落札2兆3,005億3,000万円(非競争入札:1,994億円)	4/21~2015/4/20	0.0431%	按分17.9878%	平均0.0401%					
交付税特会	1兆500億円	4/24~10/24	応札3兆1,809億円	落札1兆500億円	0.100%	按分72.8158%	平均0.099%				

「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