

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/5/1(木) <<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	2日需給予想	7日当社予想
	即日金額	金額	金額
銀行券	▲ 1,700	▲ 1,000	4,000
財政	▲ 6,200	▲ 42,600	▲ 14,000
資金過不足	▲ 7,900	▲ 43,600	▲ 10,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)			2,300
130,831			▲ 1,300
国債買現			
0			
CP買現			
0			
国庫短期証買入	25,000		
国庫短期証売却			
国債買入	9,300		
CP等買入			
	▲ 100	▲ 200	
貸出支援基金(成長)			
33,429			
(増加) 85,512			
被災地支援			
3,806			
社債等買入			
ETF買入			
国債補完供給			
小計	34,200	▲ 200	1,000
当預増減	26,300	▲ 43,800	▲ 9,000

当座預金残高	1,364,300	5/1以降の残り所要積立額
準備預金残高	1,234,200	22,000
積み終了先	1,051,400	5/2以降の残り所要積立額
超過準備	1,051,300	積数
非準備先残高	130,100	1日平均
		1,400
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,842,500	
準備預金進捗率	98.95% (実績)	53.33% (日数)

4/30のマネタリーベース		2,255,400	
4/30コール 合計	142,005 無担	44,610 有担	97,395
コール前日増減	計 ▲ 17,407 無担	▲ 15,193 有担	▲ 2,214

5/1の加重平均レート(速報)				4/30の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.060 ~0.135 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N	0.050 ~0.145 (0.065)			0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.120 (0.081)				T/N		0.065 ~0.120 (0.081)		
				S/N				
0.150 ~0.400 (0.231)				1W	0.170 (0.170)	0.088 ~0.130 (0.098)		
0.116 ~0.290 (0.146)				2W		0.118 ~0.330 (0.119)		
				3W				
0.115 ~0.118 (0.117)		0.08-0.13	-	1M	0.118 (0.118)	0.118 ~0.250 (0.122)		有担先日付分
		0.08-0.13	0.0575	2M				
0.120 (0.120)		0.08-0.13	0.057-0.058	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 5/7 ~ 8/4 (89日間) 応札 2,310億円 落札 2,310億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札29兆3,440億円 落札5兆1,717億3,000万円(非競争入札:4,782億円) 5/7~8/4 0.0574% 按分71.1720% 平均0.0570%
 流動性供給 応札 8,267億円 落札 2,986億円 5/7 募入最大利回較差 0.002% 按分 82.6462% 募入平均利回較差 0.000%

「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

<< 5/2の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,320,500	前日比	▲ 43,800
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.06~0.065%近辺での出合いが中心となるであろう。

<< 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1兆5,000億円増加の105兆1,000億円(当座預金残高見込みは136兆4,000億円)。本日の無担O/Nは大手行から0.06%程度、地銀および信託業態から0.06~0.065%の調達希望。取引は0.06~0.065%中心の立ち上がりとなった。出し取り一巡後も動意に乏しく、朝方と同様に0.06~0.065%で散発的に取引が行われ、本日の取引を終えた。ターム物は目立った引き合いに乏しく、閑散であった。

<< 1日のオープン市場動向 >>

現先レートは小幅低下。短国市場は3M物の入札が実施された。平均落札利回り0.0570%、最高落札利回り0.0574%と事前予想通りながらも、やや強めの結果となった。セカンダリーでは調整売りから0.0574~0.058%の出合いが見られた。CP市場は入札件数・発行額共に少なく、総額800億円程度の出合いと閑散。発行レートは概ね横ばいで推移。

<< 2日の材料 >>

- *3月の完全失業率(市場予想: 3.6%)
- *3月の有効求人倍率(市場予想: 1.05倍)
- *3月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比+1.0%)
- *4月のマネタリーベース
- *5月の日銀当座預金増減要因見込み(日銀 8:50)
- *米国3月の製造業新規受注・出荷・在庫 *米国4月の雇用統計

<< コール4月の加重平均レート >>

(土日を含む)	無担	0.06523%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06495%	有担	0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.22-23
0.620 0.000	14,485.13 181.02	為替(5時)	102.19-21

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	4/23	4/24	4/25	4/28	4/30	5/1
日銀当預残	1,344,100	1,328,800	1,339,500	1,334,300	1,338,000	1,364,300
準備預金残	1,221,300	1,214,700	1,219,000	1,209,900	1,213,800	1,234,200
レート	0.065%	0.065%	0.067%	0.067%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06487%	0.06488%	0.06511%	0.06524%	0.06523%	0.06500%