

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/5/8(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想		12日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		4,000		2,600		2,000
財政		6,000		500		▲ 38,000
資金過不足		10,000		3,100		▲ 36,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						2,600
131,861						▲ 1,200
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		5,100		7,000		
CP等買入		▲ 100		▲ 500		
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		200				
国債補充供給						
小計		30,200		6,500		1,400
当増減		40,200		9,600		▲ 34,600
当座預金残高	1,349,100	5/8以降の残り所要積立額				
準備預金残高	1,216,400	10,700				
積み終了先	1,039,300	5/9以降の残り所要積立額				
超過準備	1,039,300	積数				
非準備先残高	132,700	1日平均				
		1,400				
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,850,600					
準備預金進捗率	99.49%	(実績)				76.67%
		(日数)				
5/7のマネタリーベース						
2,225,100						
5/7コール合計	151,511	無担	54,264	有担	97,247	
コール前日増減	計	2,201	無担	▲ 111	有担	2,312

<< 5/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,358,700	前日比	9,600
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.065%近辺での出合いが中心となるであろう。

<< 8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3兆3,000億円増加の104兆5,000億円(当座預金残高見込みは134兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、前日の地合いを引き継ぎ、大手行から0.06%近辺、地銀および信託から0.06~0.063%の調達希望で、0.063%中心の取引からの立ち上がりとなった。出し取り一巡後は、地合いが次第に軟化していき、0.06%前後を中心に取引が行われた。午後にもレート水準に変化は見られず、0.06%程度で散発的に取引が行われ、本日の取引を終えた。ターム物は前日と同様に大手行が1W0.117%、2W0.118%で調達を行った。

<< 8日のオープン市場動向 >>

現先レートは横ばい圏での動き。短国市場では3M物の入札が実施された。落札結果は、平均落札利回り0.0549%、按分利回り0.0561%、按分率23.8922%とほぼ事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは思惑的な動きもあり、0.052%まで買い進まれた。CP市場は、償還総額1,900億円程度に対し、発行総額は1,200億円程度にとどまった。発行レートは横ばいでの出合いが中心。CP等買入オベが4,000億円が実施され、落札結果は平均落札利回り0.087% 按分落札利回り0.085%と前回比で小幅低下となった。

<< 9日の材料 >>

- *3月の景気動向指数速報
- *4月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *米国3月の卸売売上高
- *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、5/13発行)

<< 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)	101.86-88
0.600 0.000	14,163.78 130.33	為替(5時)	101.81-82

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	4/28	4/30	5/1	5/2	5/7	5/8
日銀当預残	1,334,300	1,338,000	1,364,300	1,320,600	1,308,900	1,349,100
準備預金残	1,209,900	1,213,800	1,234,200	1,191,000	1,184,800	1,216,400
レート	0.067%	0.065%	0.065%	0.067%	0.064%	0.065%
月中平均	0.06524%	0.06523%	0.06500%	0.06667%	0.06629%	0.06613%

5/8の加重平均レート(速報)				5/7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	
0.055 ~0.135 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)					O/N	0.050 ~0.135 (0.064)	0.040 ~0.050 (0.041)	
0.061 ~0.120 (0.090)						T/N		0.065 ~0.120 (0.071)	
						S/N			
0.117 (0.117)						1W	0.170 (0.170)	0.117 ~0.220 (0.120)	
0.118 ~0.340 (0.121)						2W		0.118 (0.118)	
						3W			
						1M		0.075 ~0.200 (0.084)	
						2M			
0.250 (0.250)						3M			
						6M			
						1Y			

<< オペ情報、入札結果 >>

全店共通 8,000億円 5/12 ~ 8/4 (84日間) 応札 2,550億円 落札 2,550億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
国債補完 2,000億円 5/8 ~ 5/9 (1日間) 応札 2億円 落札 2億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
CP買入 4,000億円 5/13 応札 8,165億円 落札 3,945億円 按分レート 0.085% 78.3% 平均落札レート 0.087%
T-Bill3M 応札27兆6,466億円 落札5兆2,363億9,000万円(非競争入札:4,835億円) 5/12~8/11 0.0561% 按分23.8922% 平均0.0549%
10年利付国債(表面利率0.6%) 応札7兆7,553億円 落札2兆1,905億円(I非競争入札:2,045億円) 5/12~2024/3/20 0.604% 按分11.5103% 平均

「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