

2014/5/13(火) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>> 単位 億円

	13日需給速報		14日需給予想	15日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		2,500	1,500	1,000
財政		▲ 7,700	5,500	▲ 8,000
資金過不足		▲ 5,200	7,000	▲ 7,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,600
133,191				▲ 2,100
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			20,000	
国庫短期証売却				
国債買入		9,100		
CP等買入		3,900		
		▲ 400	▲ 100	
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		12,600	19,900	500
当預増減		7,400	26,900	▲ 6,500

当座預金残高	1,326,500	5/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,195,300		3,000
積み終了先	1,021,000	5/14以降の残り所要積立額	
超過準備	1,021,000	積数	1,800
非準預先残高	131,200	1日平均	900
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	99.90% (実績)	93.33% (日数)	

5/12のマネタリーベース		2,225,700	
5/12コール	合計	160,400	無担 63,956 有担 96,444
コール前日増減	計	7,567	無担 5,948 有担 1,619

5/13 の加重平均レート(速報)				5/12 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 ~0.135 (0.066)		0.040 ~0.050 (0.041)				O/N	0.055 ~0.135 (0.065)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.120 (0.076)						T/N		0.065 ~0.120 (0.073)	
						S/N			
0.117 ~0.200 (0.159)						1W		0.117 ~0.400 (0.185)	
0.118 (0.118)						2W		0.118 (0.118)	
						3W			
				0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
				0.08-0.13	0.0400	2M			
				0.08-0.13	0.0370	3M			
				-	0.03-0.031	6M			
				-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 5/15 ~ 8/11 (88日間) 応札 2,580億円 落札 2,580億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
米ドル資金供給(固定金利方式) 5/15~5/22 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.590%
30年利付国債(表面利率1.7%) 応札2兆5,202億円 落札5,459億円(I 非競争入札:532億円) 5/15~2044/3/20 1.710% 按分82.5075% 平均1.708%
交付税特会 1兆500億円 5/21~11/19 応札 3兆3,521億円 落札1兆500億200万円 0.100% 按分 44.3040% 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

<< 5/14の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,353,400	前日比	26,900
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。					

<< 13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4,000億円増加の102兆1,000億円(当座預金残高見込みは132兆5,000億円)。無担O/Nは、大手行が0.06%近辺のビッドを示す中、地銀および信託業態が0.062~0.065%で調達を行う立ち上がりとなり、前日と同水準の取引からスタートした。出し取り一巡後もレート水準は総じて変化せず、0.06~0.063%で散発的に取引が行われ、本日の取引を終えた。ターム物は前日に引き続き、大手行が1W物0.117%、2W物0.118%で調達希望を示した。

<< 13日のオープン市場動向 >>
現先S/N物は小幅低下。短国市場は品薄感強く、気配が急低下。アウトライト市場は2M0.04%、3M0.037%、6M0.03~0.031%での出合い。CP市場は五・十日に係る発行となり、鉄鋼・電力業態からのまとまった発行案件が見られ、発行額は2,700億円程度まで膨らんだ。発行レートは投資家のニーズが強く、低位横ばい圏で推移。

<< 14日の材料 >>
*3月の特定サービス産業動態統計速報
*4月の企業物価指数
*米国4月の生産者物価指数

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	102.18-19
0.605	0.000	14,425.44	275.92	為替(5時)	102.32-33

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	5/2	5/7	5/8	5/9	5/12	5/13
日銀当預残	1,320,600	1,308,900	1,349,100	1,358,500	1,319,100	1,326,500
準備預金残	1,191,000	1,184,800	1,216,400	1,228,000	1,192,000	1,195,300
レート	0.067%	0.064%	0.065%	0.065%	0.065%	0.066%
月中平均	0.06667%	0.06629%	0.06613%	0.06582%	0.06575%	0.06577%