

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/5/15(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想		19日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		600	400	1,000		
財政		▲ 8,200	1,700	▲ 48,000		
資金過不足		▲ 7,600	2,100	▲ 47,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		2,600	12,100	2,400		
133,711		▲ 2,100	▲ 20,000	▲ 1,300		
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			5,800			
CP等買入		▲ 1,100	▲ 300			
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			100			
国債補完供給						
小計		▲ 600	▲ 2,300	1,100		
当預増減		▲ 8,200	▲ 200	▲ 45,900		

当座預金残高	1,345,300	5/15以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,222,500		400
積み終了先	1,042,100	5/16以降の残り所要積立額	
超過準備	1,041,700	積数	1,892,400
非準預先残高	122,800	1日平均	61,000
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,850,500		

5月の新所要見込 61,000 (一日平均)

5/14のマネタリーベース		2,256,000	
5/14コール	合計	158,334	無担 64,690 有担 93,644
コール前日増減	計	▲ 2,529	無担 316 有担 ▲ 2,845

5/15の加重平均レート(速報)			5/14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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.055 ~0.135 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)		0.060 ~0.135 (0.067)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.065 ~0.120 (0.080)				0.067 ~0.120 (0.083)		
0.117 ~0.170 (0.135)				0.073 ~0.130 (0.107)		
0.118 ~0.285 (0.125)				0.118 ~0.330 (0.131)		
0.090 ~0.250 (0.119)		0.08-0.13		0.118 ~0.360 (0.120)	有担先日付分	
		0.08-0.13	0.0410			
		0.08-0.13	0.036-0.041			
		-	-			
		-	-			
		-	-			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 5/19 ~ 8/11 (84日間) 応札 2,370億円 落札 2,370億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札23兆6,040億円 落札5兆2,226億3,000万円(非競争入札:4,473億円) 5/19~8/18 0.0401% 按分8.1556% 平均0.0369%
 5年利付国債(表面利率0.2%) 応札11兆3,890億円 落札2兆4,667億円(I非競争入札:2,319億円) 5/19~2019/3/20 0.185% 按分42.5738% 平均0.185%
 ETF買入 119億円 約定日 5/15

「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

<< 5/16の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,345,100	前日比	▲ 200
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.06~0.065%近辺での出合いが中心となるであろう。

<< 15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1兆円減少の104兆円(当座預金残高見込みは134兆5,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06%付近、地銀および信託業態から0.06~0.065%のビッドが見られた。積み最終日ながら、大手行が朝方から底堅い調達意欲を見せた前日に比べると、地合いはやや軟化し、0.063%近辺の取引が中心となる立ち上がりとなった。出し取り一巡後も、0.06~0.062%を中心に散発的な取引が行われた。午後は調整の動きが若干見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は大手行が2Wおよび1M物を0.118%でビッドし、まとまった出合いが見られた。

<< 15日のオープン市場動向 >>

現先S/N物は横ばい圏で推移。短国市場は3M物の入札が実施された。W I取引において0.035~0.036%で出合いが見られた事もあり、落札結果は平均落札利回0.0369%、按分落札利回0.0401%と予想通りの結果。セカンダリー市場では0.041%での調整売りも散見された。CP市場は、償還額400億円程度に対し、発行額は500億円程度と発行案件に乏しく閑散。発行レートは概ね横ばい圏での動き。

<< 16日の材料 >>

- *3月の石油等消費動態統計
- *米国4月の住宅着工件数
- *米国5月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、5/20発行)

<< コール4月積み期間分の加重平均レート >>

(土日を含む)	無担	0.06567%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06532%	有担	0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.78-79
0.590 ▲ 0.010	14,298.21 ▲ 107.55	為替(5時)	102.02-03

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	5/8	5/9	5/12	5/13	5/14	5/15
日銀当預残	1,349,100	1,358,500	1,319,100	1,326,500	1,353,500	1,345,300
準備預金残	1,216,400	1,228,000	1,192,000	1,195,300	1,228,100	1,222,500
レート	0.065%	0.065%	0.065%	0.066%	0.067%	0.065%
月中平均	0.06613%	0.06582%	0.06575%	0.06577%	0.06586%	0.06580%