

2014/5/21(水)

<<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

| | 21日需給速報 | | 22日需給予想 | 23日当社予想 |
|-------------------|---------|--------|----------|---------|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | ▲ 400 | ▲ 1,500 | ▲ 1,000 |
| 財政 | | 4,100 | ▲ 11,100 | 26,000 |
| 資金過不足 | | 3,700 | ▲ 12,600 | 25,000 |
| 貸出 | | | | |
| 売出手形 | | | | |
| 0 | | | | |
| 本店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 全店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 共通(固定) | | | | |
| 126,874 | | | | |
| 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 | | 5,200 | | |
| CP等買入 | | ▲ 400 | 3,800 | ▲ 400 |
| 貸出支援基金(成長) | | | | |
| 33,429(増加) 85,512 | | | | |
| 被災地支援 | | | | 0 |
| 3,806 | | | | 0 |
| 社債等買入 | | | | |
| ETF買入 | | 100 | 100 | |
| 国債補完供給 | | | | |
| 小計 | | 29,900 | 3,500 | 0 |
| 当預増減 | | 33,600 | ▲ 9,100 | 25,000 |

| 当座預金残高 | 1,322,500 | 5/21以降の残り所要積立額 | |
|---------------------------|-------------|----------------|-------------|
| 準備預金残高 | 1,185,600 | | 188,200 |
| 積み終了先 | 981,600 | 5/22以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 981,500 | 積数 | 163,900 |
| 非準備先残高 | 136,900 | 1日平均 | 6,600 |
| 積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数) | | | 1,892,400 |
| 準備預金進捗率 | 91.34% (実績) | | 19.35% (日数) |

| 5/20のマネタリーベース | | 2,188,800 | |
|---------------|------------|-----------|-----------|
| 5/20コール | 合計 165,862 | 無担 68,247 | 有担 97,615 |
| コール前日増減 | 計 6,730 | 無担 5,204 | 有担 1,526 |

| 5/21の加重平均レート(速報) | | | | 5/20の加重平均レート(確報) | | | |
|----------------------|----------------------|-----------|-------------|--------------------------|----------------------|--------|--------|
| 無担(平均) | | 有担(平均) | | 無担当日分 | | 無担先日付分 | |
| 0.050 ~0.135 (0.089) | 0.040 ~0.050 (0.041) | | | O/N 0.060 ~0.135 (0.067) | | | 有担当当日分 |
| 0.120 (0.120) | | | | T/N | 0.063 ~0.120 (0.076) | | |
| | | | | S/N | | | |
| 0.089 ~0.130 (0.109) | | | | 1W | 0.116 ~0.285 (0.127) | | |
| 0.118 (0.118) | | | | 2W | 0.290 ~0.330 (0.294) | | |
| | | | | 3W | | | |
| 0.118 (0.118) | | 0.08-0.13 | - | 1M | 0.118 ~0.190 (0.122) | | 有担先日付分 |
| | | 0.08-0.13 | 0.035~0.040 | 2M | | | |
| | | 0.08-0.13 | 0.025~0.031 | 3M | | | |
| | | - | - | 6M | | | |
| | | - | 0.0340 | 1Y | | | |

<<オペ情報、入札結果>>

本日は日本銀行による調節はありませんでした。

<<日銀金融政策決定会合・結果>>

・マネタリーベースが、年間約60~70兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(全員一致)

・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。

- ①長期国債について、保有残高が年間約50兆円に相当するペースで増加し、平均残存期間が7年程度となるよう買入れを行う。
- ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約1兆円、年間約300億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
- ③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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録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

| << 5/22の日銀調節とレート予想 >> | | | | | |
|-----------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 1,313,400 | 前日比 | ▲ 9,100 |
| 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%程度での出合いが中心となろう。

<< 21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2兆2,000億円増加の100兆8,000億円(当座預金残高見込みは132兆円)。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0.065~0.07%程度のビッドが見られた。また、証券業態から試し取りと見られる動きがあり、0.12%を超える水準でまとまった出合いが見られた。一巡後の出合いは、0.07%前後で推移した。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1W物を0.117%、1M物を0.118%でビッドし、まとまった出合いが見られた。

<< 21日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは、引き続き横ばい圏で推移した。短国アウトライトは、店頭見合いから2M:0.035~0.040%、3M:0.025~0.031%、1Y:0.034%の水準で散発的な出合いが見られる程度で閑散としていた。CP市場は、石油業態からまとまった発行が実施され、発行総額が約2,000億円に上った。発行レートは、一部の銘柄で若干低下。

<< 22日の材料 >>

- *日銀金融経済月報
- *米国4月の中古住宅販売
- *英国1-3月期のGDP改定値
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、5/26発行)
- *流動性供給入札(4,000億円、5/26発行)

| JGB新発10年債 | 日経平均株価(終値) | 為替(9時) | 101.27-28 |
|-----------|------------|-----------|-----------|
| 0.590 | 0.000 | 14,042.17 | ▲ 33.08 |
| | | 為替(5時) | 100.94-95 |

| 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 | 5/14 | 5/15 | 5/16 | 5/19 | 5/20 | 5/21 |
| 日銀当預残 | 1,353,500 | 1,345,300 | 1,345,000 | 1,293,100 | 1,288,900 | 1,322,500 |
| 準備預金残 | 1,228,100 | 1,222,500 | 1,214,200 | 1,179,400 | 1,162,200 | 1,185,600 |
| レート | 0.067% | 0.065% | 0.067% | 0.067% | 0.067% | 0.089% |
| 月中平均 | 0.06586% | 0.06580% | 0.06600% | 0.06605% | 0.06610% | 0.06719% |