

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/5/26(月) <セントラル短資株式会社>

<<資金需給>>

単位 億円

	26日需給速報		27日需給予想		28日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		400		500		0
財政		▲ 16,400		14,900		3,000
資金過不足		▲ 16,000		15,400		3,000
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		2,500		5,400		1,400
127,169		▲ 2,200		▲ 12,600		▲ 3,300
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				6,800		4,000
CP等買入						
		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512 被災地支援 3,782						
社債等買入				▲ 100		
ETF買入		100				
国債補完供給						
小計		200		19,300		2,100
当預増減		▲ 15,800		34,700		5,100

<< 5/27の日銀調節とレート予想 >>						
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,357,200	前日比	34,700	
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。

<< 26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1兆7,000億円減少の101兆9,000億円(当座預金残高見込みは132兆3,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06%、地銀および信託業態から0.065%前後のビッドが見られた。一巡後の出合いは、0.06~0.065%程度で推移した。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。

<< 26日のオープン市場動向 >>

現先取引S/Nは前営業日同水準で推移。短国市場は終日閑散の地合いのなか、6M物で0.04%の出合いが見られた程度。CP発行市場は月末が近づき、発行総額は償還額よりやや多めの1,400億円弱となった。レート水準は期間が短いものを中心に若干の上昇も見られたが、概ね横ばい圏であった。

<< 27日の材料 >>

- *4月の企業向けサービス価格指数
- *米国3月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- *米国4月の耐久財新規受注 *米国5月のC B消費者信頼感指数
- *40年利付国債入札(4,000億円、5/29発行)

当座預金残高	1,322,500	5/26以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,199,800		95,900
積み終了先	1,005,500	5/27以降の残り所要積立額	
超過準備	1,005,300	積数	81,800
非準預先残高	122,700	1日平均	4,100

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 95.68% (実績) 35.48% (日数)

JGB新発10年債	0.590	0.000	日経平均株価(終値)	14,602.52	140.35	為替(9時)	101.98-99
						為替(5時)	101.92-93

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	5/19	5/20	5/21	5/22	5/23	5/26
日銀当預残	1,293,100	1,288,900	1,322,500	1,313,800	1,338,300	1,322,500
準備預金残	1,179,400	1,162,200	1,185,600	1,189,600	1,209,100	1,199,800
レート	0.067%	0.067%	0.089%	0.067%	0.068%	0.068%
月中平均	0.06605%	0.06610%	0.06719%	0.06718%	0.06728%	0.06731%

5/23のマネタリーベース			2,241,500			
5/23コール	合計	170,030	無担	72,692	有担	97,338
コール前日増減	計	1,572	無担	1,249	有担	323

5/26の加重平均レート(速報)				5/23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 (0.068)	0.040 ~0.050 (0.041)							O/N	0.050 ~0.135 (0.068)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.120 (0.099)						T/N		0.065 ~0.120 (0.081)			
						S/N					
0.117 ~0.400 (0.166)						1W		0.118 (0.118)			
0.118 (0.118)						2W					
						3W		0.120 (0.120)			
0.090 (0.090)				0.08-0.13	-	1M					有担先日付分
				0.08-0.13	-	2M					
0.118 (0.118)				0.08-0.13	-	3M					
				-	0.0400	6M					
				-	-	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	5/28 ~ 8/18 (82日間)	応札	1,390億円	落札	1,390億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	2,000億円	5/26 ~ 5/27 (1日間)	応札	10億円	落札	10億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	4,000億円	5/28	応札	11,458億円	落札	4,009億円	按分利回り較差	0.002%	76.0%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	200億円	5/28	応札	826億円	落札	201億円	按分価格較差	-0.12円	62.9%	平均価格較差	-0.221円

「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