

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/5/28(水)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	28日需給速報		29日需給予想	30日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		0	▲ 600	▲ 500
財政		▲ 900	▲ 2,700	6,500
資金過不足		▲ 900	▲ 3,300	6,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,400		
118,064		▲ 3,300		
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		4,300		6,700
CP等買入				3,700
		▲ 400	▲ 300	
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			▲ 300	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		2,000	▲ 600	10,400
当預増減		1,100	▲ 3,900	16,400

当座預金残高	1,357,800	5/28以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,230,900		68,300
積み終了先	1,043,200	5/29以降の残り所要積立額	
超過準備	1,041,900	積数	55,100
非準預先残高	126,900	1日平均	3,100
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	97.09%	(実績)	41.94% (日数)

5/27のマネタリーベース		2,259,100	
5/27コール	合計	168,361	無担 69,322 有担 99,039
コール前日増減	計	2,560	無担 1,450 有担 1,110

5/28 の加重平均レート(速報)					5/27 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	有担先日付分		
0.045 ～0.135 (0.065)	0.040 ～0.050 (0.041)			O/N	0.045 ～0.135 (0.066)		0.040 ～0.050 (0.041)			
0.063 ～0.120 (0.075)				T/N		0.065 ～0.120 (0.075)				
				S/N						
0.116 ～0.130 (0.121)				1W		0.073 ～0.200 (0.107)				
0.117 ～0.330 (0.136)				2W						
				3W						
0.118 (0.118)		0.08-0.13	-	1M		0.118 (0.118)	有担先日付分			
		0.08-0.13	-	2M						
		0.08-0.13	-	3M						
		-	-	6M						
		-	0.0350	1Y						

《オペ情報、入札結果》

国債買入	2,500億円	5/30	応札	14,346億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	0.006%	96.5%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	2,500億円	5/30	応札	13,394億円	落札	2,503億円	按分利回り較差	0.003%	30.4%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	1,700億円	5/30	応札	4,756億円	落札	1,706億円	按分利回り較差	0.000%	33.3%	平均利回り較差	0.002%
米ドル資金供給(固定金利方式)		5/30～6/5 (6日間)	応札なし	貸付利率	0.600%						
交付税特会	1兆500億円	6/5～12/4	応札2兆9,226億円	落札1兆500億100万円	0.100%	按分	57.7213%	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

《 5/29の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,353,900	前日比	▲ 3,900
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%程度での出合いが中心となろう。					

《 28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1,000億円増加の105兆4,000億円(当座預金残高見込みは135兆8,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06%、地銀および信託業態から0.06～0.065%程度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。

《 28日のオープン市場動向 》

現先取引S/Nはほぼ横ばい圏で推移。短国市場では閑散な地合いは変わらず、1Y物で0.035%の出合いが見られた程度。CP発行市場は月末取引のため鉄鋼・石油・化学など幅広い業態からまとまった発行がみられ、総額は6,500億円程度に上った。昨日のCP等買入オペが前回比上昇したこともあり、レート水準は概ね小幅上昇となった。

《 29日の材料 》

*4月の商業販売統計速報

*白井日銀審議委員、沖縄県金融経済懇談会にて講演

*米国1-3月期のGDP改定値

*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、6/2発行)

*2年利付国債入札(27,000億円、6/15発行)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	101.98-00
0.585	▲ 0.005	14,670.95	34.43	為替(5時)	101.81-83

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	5/21	5/22	5/23	5/26	5/27	5/28
日銀当預残	1,322,500	1,313,800	1,338,300	1,322,500	1,356,700	1,357,800
準備預金残	1,185,600	1,189,600	1,209,100	1,199,800	1,228,000	1,230,900
レート	0.089%	0.067%	0.068%	0.068%	0.066%	0.065%
月中平均	0.06719%	0.06718%	0.06728%	0.06731%	0.06726%	0.06718%