

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/5/29(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想		2日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900		▲ 500		1,000
財政		▲ 1,800		1,100		▲ 21,000
資金過不足		▲ 2,700		600		▲ 20,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						3,400
118,064						▲ 3,400
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				6,800		
CP等買入				3,700		
		▲ 300		▲ 2,800		
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		▲ 100		
ETF買入						
国債補完供給						
小計		▲ 600		7,600		0
当預増減		▲ 3,300		8,200		▲ 20,000

当座預金残高	1,354,500	5/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,224,700		55,100
積み終了先	1,040,700	5/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,039,700	積数	47,500
非準備預金残高	129,800	1日平均	2,800
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	97.49%	(実績)	45.16% (日数)

5/28のマナタリーベース		2,260,200	
5/28コール 合計	166,343	無担	66,825
有担		有担	99,518
コール前日増減	計	▲ 2,018	無担 ▲ 2,497
			有担 479

5/29の加重平均レート(速報)			5/28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
0.060 ~0.135 (0.070)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.045 ~0.135 (0.065)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.120 (0.081)				T/N	0.063 ~0.120 (0.075)	
				S/N		
				1W 0.117 (0.117)	0.116 ~0.130 (0.123)	
0.118 (0.118)				2W	0.117 ~0.330 (0.136)	
				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	0.0450-0.0540	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 6/2 ~ 8/25 (84日間) 応札 3,430億円 落札 3,430億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 成長基盤強化 (ABL等特則 小口特則 ミドル特則)
 T-Bill3M 応札26兆1,527億円 落札5兆2,527億8,000万円(非競争入札:4,272億円) 6/2~9/1 0.0501% 按分55.1125% 平均0.0465%
 2年利付国債(表面利率0.10%) 応札15兆3,917億円 落札2兆4,824億円(I 非競争入札:13億8,300万円) 6/16~16/6/15 0.0870%按分79.6703%平均0.0860%
 J-REIT買入 3億円 約定日 5/29

「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

<< 5/30の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,362,700	前日比	8,200
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.065%程度での出合いが中心となろう。

<< 29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9,000億円減少の104兆5,000億円(当座預金残高見込みは135兆4,000億円)。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。午後は証券業態から試し取りと思われる動きがあり、0.12%を超える水準での出合いが見られた。

<< 29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3M物の入札が実施された。WI取引で0.045~0.046%の出合いが見られたものの、平均落札利回り0.0465%・按分落札利回り0.0501%と小甘い結果となった。セカンダリー市場では一時調整売りから0.054%の出合いも見られた。CP発行市場は鉄鋼・電機・食品などの業態からまとまった額の発行があり、発行総額は3,400億円に上った。大半の案件が6月末までの償還物であったため、慎重な応札が目立ち、レート水準は上昇した。

<< 30日の材料 >>
 *4月の完全失業率(市場予想:3.6%)
 *4月の有効求人倍率(市場予想:1.07倍)
 *4月の全世帯家計調査(市場予想:全世帯消費支出、前年比▲3.2%)
 *4月全国・5月都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想:全 国(4月)前年同月比(除く生鮮):+3.1%
 東京都区部(5月)前年同月比(除く生鮮):+2.9%
 *4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲2.0%)
 *4月の住宅着工統計
 *米国4月の個人所得・消費支出
 *米国5月のシカゴPM景況感指数

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.72-73
0.575 ▲ 0.005	14,681.72 10.77	為替(5時)	101.57-58

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	5/22	5/23	5/26	5/27	5/28	5/29
日銀当預残	1,313,800	1,338,300	1,322,500	1,356,700	1,357,800	1,354,500
準備預金残	1,189,600	1,209,100	1,199,800	1,228,000	1,230,900	1,224,700
レート	0.067%	0.068%	0.068%	0.066%	0.065%	0.070%
月中平均	0.06718%	0.06728%	0.06731%	0.06726%	0.06718%	0.06728%