CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/4/9(木)　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	▲ 100	1,000
財政		▲ 6,600	▲ 2,100	▲ 11,000
資金過不足		▲ 6,400	▲ 2,200	▲ 10,000
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 67,368				1,000 ▲ 900
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				
CP等買入		▲ 400	4,000 ▲ 700	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470				
被災地支援 3,252				
社債等買入				
ETF買入		200	100	
国債補完供給		100		
小計		▲ 100	3,400	100
当預増減		▲ 6,500	1,200	▲ 9,900

当座預金残高	2,039,000	4/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,868,900		200
積み終了先	1,549,000	4/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,549,000	積数	100
非準預先残高	170,100	1日平均	0
積み期間(3/16～4/15)の所要準備額(積数)			1,984,900

準備預金進捗率　99.99%　(実績)　80.65%　(日数)

4/8のマネタリーベース				2,982,700		
4/8コール	合計	201,149	無担	75,133	有担	126,016
コール前日増減	計	3,814	無担	3,221	有担	593

≪ 4/10の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,040,200	前日比	1,200
O／N	0.05～0.06	T／N	0.05～0.12	S／N	0.05～0.12

無担O/Nは0.05～0.06%前後での出合いが中心になると見込まれる。

≪ 9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154兆8,000億円(当座預金残高見込みは203兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態を中心に0.052～0.055%程度での調達で始まった。出合いの中心レートは0.055%で、一巡後は0.05～0.055%前後の調達で推移し、一部業態による取り上がりも散見される中で本日の取引を終了した。3M物の共通担保オペが8,000億円オファーされ、結果は落札総額950億円（期落ち分910億円）で札割れとなった。

≪ 9日のオープン市場動向 ≫

現先取引S/Nは低位で推移した。短国市場は3M物の入札が実施され、各落札利回りは平均0.0032%、按分0.0040%と市場予想よりやや強めの結果となった。セカンダリー市場では一部ショートカバーとともに、明日実施が予想される短国買入オペを見越してか、売り買いが交錯する地合いとなった。CP市場は鉄鋼業態で大型案件が見られたものの件数少なく、発行総額は1,300億円程度となった。レート水準に大きな変化は見られなかった。

≪ 10日の材料 ≫

*米国3月の財政収支

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	120.09-11
0.360	0.000	19,937.72	147.91	為替(5時)	120.27-29

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	4/2	4/3	4/6	4/7	4/8	4/9
日銀当預残	2,011,600	2,029,000	2,000,800	2,037,500	2,045,500	2,039,000
準備預金残	1,846,500	1,860,800	1,838,400	1,870,600	1,872,000	1,868,900
レート	0.057%	0.058%	0.057%	0.058%	0.059%	0.059%
月中平均	0.05650%	0.05740%	0.05733%	0.05743%	0.05763%	0.05778%

4/9 の加重平均レート(速報)					4/8 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	
0.045 ～0.130 (0.059)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N	0.045 ～0.130 (0.059)		0.030 ～0.040 (0.031)	
0.051 ～0.120 (0.063)				T/N		0.020 ～0.120 (0.059)		
				S/N		0.080 ～0.090 (0.085)		
0.116 (0.116)				1W		0.116 ～0.340 (0.193)		
				2W		0.118 (0.118)		
				3W				
0.180 ～0.200 (0.192)		0.08-0.13	-	1M		0.170 (0.170)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.010-0.005	3M		0.125 (0.125)		
		-	▲0.014-▲0.009	6M				
		-	-	1Y				

≪オペ情報、入札結果≫

全店共通　8,000億円　4/13　～　7/13　(91日間) 応札　950億円　落札　950億円　0.100%　全 取　平 均　0.100% (固定)

T-Bill3M　応札16兆4,579億円 落札4兆9,299億5,000万円(非競争入札:4,400億円) 4/13～7/13 0.0040% 按分95.7656% 平均0.0032%

30年利付国債(表面利率1.5%) 応札2兆848億円　落札7,298億円(Ⅰ非競争入札:695億円) 4/13～2045/3/20 1.384% 按分3.2315% 平均1.375%

交付税特会 1兆500億円 4/16～10/16 応札 3兆5,560億円　落札 1兆500億円　0.090% 按分 38.0000% 平均 0.086%

「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