CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/4/14(火)　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	14日需給速報		15日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		400	▲ 100	0
財政		2,000	59,200	▲ 25,000
資金過不足		2,400	59,100	▲ 25,000
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 67,408				
国債買現 0				
CP買現 0				
国庫短期証買入		17,500		
国庫短期証売却				
国債買入		11,600	4,800	
CP等買入		▲ 300	▲ 300	
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			100	
国債補完供給				
小計		28,800	4,600	0
当預増減		31,200	63,700	▲ 25,000

当座預金残高	2,052,300	4/14以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,874,600		0
積み終了先	1,555,400	4/15以降の残り所要積立額	
超過準備	1,555,300	積数	0
非準預先残高	177,700	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　100.00%　(実績)　96.77%　(日数)

4/13のマネタリーベース				2,956,900		
4/13コール	合計	199,220	無担	72,187	有担	127,033
コール前日増減	計	2,409	無担	2,218	有担	191

≪ 4/15の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,116,000	前日比	63,700
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。

≪ 14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3兆1,000億円増加の155兆9,000億円(当座預金残高見込みは205兆3,000億円)。無担O/Nは大手行から0.05%、地銀･信託業態から0.055～0.06%前後での調達がみられた。一巡後は、0.055～0.057%近辺の出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から2W物の調達が0.118%で行われ、まとまった出合いがみられた。

≪ 14日のオープン市場動向 ≫

現先S/Nは横ばい圏での推移となった。短国市場では2M物が0.02%で小額の出合いがみられた程度で、閑散であった。CP市場は償還総額300億円程度に対し、発行総額は1,300億円程度と膨らんだ。発行レートは、横ばいから小幅低下して決着する銘柄が多くみられた。

≪ 15日の材料 ≫

*黒田日銀総裁、第90回信託大会にて講演
*2月の石油等消費動態統計
*米国ベージュブック　*米国3月の鉱工業生産・設備稼働率
*ECB定例理事会(金融政策発表)
*国庫短期証券入札(1年、25,000億円、4/20発行)
*交付税特別会計借入(10,500億円、4/23借入)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	120.05-07
0.325	▲ 0.015	19,908.68	3.22	為替(5時)	119.86-88

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	4/7	4/8	4/9	4/10	4/13	4/14
日銀当預残	2,037,500	2,045,500	2,039,000	2,040,100	2,021,100	2,052,300
準備預金残	1,870,600	1,872,000	1,868,900	1,861,800	1,845,200	1,874,600
レート	0.058%	0.059%	0.059%	0.061%	0.060%	0.059%
月中平均	0.05743%	0.05763%	0.05778%	0.05858%	0.05869%	0.05871%

4/14 の加重平均レート(速報)　　4/13 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
0.010 ～0.125 (0.059)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N	0.010 ～0.125 (0.060)		0.030 ～0.040 (0.031)
0.056 ～0.120 (0.065)				T/N		0.055 ～0.130 (0.059)	
				S/N			
0.065 ～0.260 (0.112)				1W		0.076 ～0.125 (0.082)	
0.118 (0.118)				2W			
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
0.150 (0.150)		0.08-0.12	0.0200	2M			
		0.08-0.12	-	3M			
		-	-	6M		0.135 (0.135)	
		-	-	1Y			

≪オペ情報、入札結果≫

米ドル資金供給(固定金利方式)　4/16～4/23 (7日間)　応札なし　貸付利率　0.620%
5年利付国債(表面利率0.1%)　応札7兆7,183億円　落札2兆2,850億円(I非競争入札:2,132億円) 4/16～2020/3/20 0.083%　按分26.3547% 平均0.081%

「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