

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/4/15(水) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想	17日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 700	▲ 1,000
財政		58,900	▲ 26,100	2,000
資金過不足		58,800	▲ 26,800	1,000
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				
国庫短期証売却				
国債買入		4,800		11,500
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				800
ETF買入		100	300	
国債補完供給				
小計		4,600	0	12,300
当増減		63,400	▲ 26,800	13,300

当座預金残高	2,115,700	4/15以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	1,933,800		
積み終了先	1,601,100	4/16以降の残り所要積立額	積数 1,931,600
超過準備	1,601,100		1日平均 64,400
非準備先残高	181,900		
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,984,900		

4月の新所要見込 64,400 (一日平均)

4/14のマナリーベース		2,987,800	
4/14コール	合計	201,191	無担 74,076 有担 127,115
コール前日増減	計	1,971	無担 1,889 有担 82

4/15の加重平均レート(速報)				4/14の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.045 ~0.125 (0.061)	0.030	~0.040 (0.031)		0.010 ~0.125 (0.059)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.056 ~0.125 (0.081)					0.056 ~0.120 (0.065)		
0.090 (0.090)							
0.117 (0.117)					0.065 ~0.260 (0.112)		
0.118 ~0.310 (0.121)					0.118 (0.118)		
0.088 (0.088)							
		0.08-0.13	-				有担先日付分
		0.08-0.12	0.0200		0.150 (0.150)		
		0.08-0.12	-				
		-	-				
		-	▲0.0100				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,215億円	4/15 ~ 4/16 (1日間)	応札 21億円	落札 21億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債買入	3,750億円	4/17	応札 9,811億円	落札 3,753億円	按分利回り較差 0.002%	28.4%	平均利回り較差 0.003%
国債買入	3,750億円	4/17	応札 9,593億円	落札 3,753億円	按分利回り較差 0.006%	82.4%	平均利回り較差 0.007%
国債買入	4,000億円	4/17	応札 9,468億円	落札 4,006億円	按分利回り較差 0.010%	85.2%	平均利回り較差 0.012%
T-Bill1Y	応札11兆491億円	落札2兆3,067億3,000万円 (非競争入札:1,932億円)	4/20 ~2016/4/20	-0.019%	按分4.6143%	平均-0.0059%	
交付税特会	1兆500億円	4/23~10/22	応札3兆2,300億円	落札1兆500億円	0.088%	按分76.0000%	平均0.085%
J-REIT買入	12億円	約定日 4/15					

4/16の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,088,900	前日比	▲ 26,800
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。

<< 15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4兆2,000億円増加の160兆1,000億円(当座預金残高見込みは211兆6,000億円)。積みの最終日である本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.055~0.06%前後、大手行から0.05%での調達が見られた。一巡後は、0.055%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1W物で0.117%、2W物の調達が0.118%で行われた。

<< 15日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばい圏での動きとなった。短国市場では1年物(526回)入札が実施された。入札結果は、平均落札利回り▲0.0059% 按分落札利回り▲0.0019%と強めの結果となった。セカンダリーは▲0.01%での出合いもみられた。CP市場では償還総額900億円程度に対し、発行総額は800億円程度となった。発行レートは、ディーラー・投資家の運用ニーズが強く、小幅低下しての決着となる銘柄が多く見られた。

<< 16日の材料 >>
 *米国3月の住宅着工件数
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、4/20発行)
 *20年利付国債入札(12,000億円、4/20発行)

◀コール3月積み期間分の加重平均レート▶			
(土日を含む)	無担	0.06181%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06139%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.325	0.000	日経平均株価(終値)	19,869.76	▲ 38.92	為替(9時)	119.45-47
						為替(5時)	119.49-52

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	4/8	4/9	4/10	4/13	4/14	4/15
日銀当預残	2,045,500	2,039,000	2,040,100	2,021,100	2,052,300	2,115,700
準備預金残	1,872,000	1,868,900	1,861,800	1,845,200	1,874,600	1,933,800
レート	0.059%	0.059%	0.061%	0.060%	0.059%	0.061%
月中平均	0.05763%	0.05778%	0.05858%	0.05869%	0.05871%	0.05887%

「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