CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/4/27(月)　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	27日需給速報		28日需給予想	30日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,100	▲ 3,700	▲ 1,900
財政		▲ 8,800	▲ 400	▲ 1,200
資金過不足		▲ 10,900	▲ 4,100	▲ 3,100
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 67,642		2,600 ▲ 2,900		
国債買現 0				
CP買現 0				
国庫短期証買入			25,000	
国庫短期証売却				
国債買入			5,700	11,500
CP等買入		▲ 500	▲ 200	4,000
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470				
被災地支援 3,251				
社債等買入		▲ 100	▲ 300	
ETF買入			300	
国債補完供給				
小計		▲ 900	30,500	15,500
当預増減		▲ 11,800	26,400	12,400

当座預金残高	2,075,600	4/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,890,300		10,600
積み終了先	1,557,800	4/28以降の残り所要積立額	
超過準備	1,557,800	積数	9,400
非準預先残高	185,300	1日平均	500
積み期間(4/16～5/15)の所要準備額(積数)			1,932,200

準備預金進捗率　99.51%　(実績)　40.00%　(日数)

4/24のマネタリーベース			3,034,600		
4/24コール	合計	210,901	無担	85,741	有担	125,160
コール前日増減	計	▲ 930	無担	▲ 545	有担	▲ 385

≪ 4/28の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,102,000	前日比	26,400
O／N	0.055～0.065	T／N	0.05～0.12	S／N	0.05～0.12

無担O/Nは0.055～0.065%前後での出合いが中心になると見込まれる。

≪ 27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1兆円減少の156兆2,000億円(当座預金残高見込は207兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.055～0.057%近辺、地銀･信託業態から0.06～0.063%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.063～0.065%の出合いが中心となった。一巡後も0.063%近辺での出合いで推移したが、後場には0.055～0.06%の出合いに落ち着いた。ターム物は、閑散な出合いとなった。

≪ 27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。短国市場は総じて動意に乏しく、3Mで▲0.02%の少額の出合いが見られた程度であった。CP発行市場は、2営業日後が月末日にあたったため、発行額が8,100億円程度に膨らんだ。1兆円程度の償還額には及ばなかったものの、複数の大型発行案件が実施される活況なマーケットとなった。発行レートは依然として落ち着いた水準での決着が中心となっていた。

≪ 28日の材料 ≫

*3月の商業動態統計速報
*米国FOMC(1日目)
*米国2月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*米国4月のCB消費者信頼感指数
*英国1-3月期のGDP速報値
*国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、5/7発行)
*2年利付国債入札(25,000億円、5/15発行)
*交付税特別会計借入(10,500億円、5/13借入)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	118.91-93
0.300	0.015	19,983.32	▲ 36.72	為替(5時)	119.20-23

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	4/20	4/21	4/22	4/23	4/24	4/27
日銀当預残	2,035,800	2,083,400	2,070,300	2,064,100	2,087,400	2,075,600
準備預金残	1,855,600	1,902,400	1,884,800	1,880,400	1,901,500	1,890,300
レート	0.062%	0.062%	0.062%	0.063%	0.065%	0.064%
月中平均	0.06000%	0.06010%	0.06018%	0.06030%	0.06085%	0.06096%

4/27 の加重平均レート(速報)

無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国
0.050 ～0.125 (0.064)	0.030 ～0.040 (0.031)		
0.061 ～0.130 (0.077)			
0.116 ～0.130 (0.128)			
0.260 (0.260)		0.08-0.13	－
		0.08-0.12	－
		0.08-0.12	▲0.020
		－	－
		－	－

4/24 の加重平均レート(確報)　単位 (%)

	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
O/N	0.055 ～0.125 (0.065)		0.030 ～0.040 (0.031)
T/N		0.062 ～0.130 (0.079)	
S/N			
1W	0.117 (0.117)	0.114 ～0.200 (0.128)	
2W		0.087 ～0.180 (0.109)	
3W			
1M			有担先日付分
2M			
3M			
6M			
1Y			

≪オペ情報、入札結果≫

国債補完	4,000億円	4/27	～	4/28	(1日間)	応札	9億円	落札	9億円	-0.400%	全 取	平 均 -0.400% (即)
国債買入	3,750億円	4/30	応札	13,105億円	落札	3,760億円	按分利回り較差	0.007%	92.9%	平均利回り較差	0.007%	
国債買入	3,750億円	4/30	応札	16,280億円	落札	3,759億円	按分利回り較差	0.004%	1.0%	平均利回り較差	0.006%	
国債買入	4,000億円	4/30	応札	13,375億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	-0.002%	69.8%	平均利回り較差	-0.002%	

「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