

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/5/12(火) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	12日需給速報	13日需給予想	14日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	3,000	1,900	2,000
財政	▲ 13,100	▲ 300	▲ 39,000
資金過不足	▲ 10,100	1,600	▲ 37,000
貸出			
売出手形	0		
本店共通	0		
全店共通	0		
共通(固定)	67,672		
国債買現	0		
CP買現	0		
国庫短期証買入		20,000	
国庫短期証売却			
国債買入		11,800	
CP等買入		3,500	
	▲ 300	▲ 500	
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			
ETF買入	100		
国債補完供給	200		
小計	0	34,800	0
当預増減	▲ 10,100	36,400	▲ 37,000

当座預金残高	2,080,200	5/12以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,894,700		200
積み終了先	1,580,800	5/13以降の残り所要積立額	
超過準備	1,580,800	積数	100
非準預先残高	185,500	1日平均	0
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,951,300		
準備預金進捗率	99.99% (実績)	90.00% (日数)	

5/11のマネタリーベース	3,037,000
5/11コール 合計	204,853 無担 79,515 有担 125,338
コール前日増減 計	▲ 305 無担 ▲ 1,273 有担 968

5/12 の加重平均レート(速報)				5/11 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	
0.055 ~0.125 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.055 ~0.125 (0.067)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.057 ~0.071 (0.069)				T/N		0.058 ~0.120 (0.069)		
				S/N				
0.070 ~0.200 (0.087)				1W		0.065 ~0.130 (0.081)		
0.145 (0.145)				2W		0.180 (0.180)		
				3W				
		0.08-0.13	-	1M		0.200 (0.200)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.005	3M				
		-	▲0.017-▲0.009	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 5/14~5/21 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.630%

T-Bill6M 応札14兆5,646億5,000万円 落札3兆2,264億2,000万円(非競争入札:2,735億円) 5/14~11/10 ▲0.0060% 按分66.2644% 平均▲0.0060%

10年利付国債(表面利率0.4%) 応札4兆9,186億円 落札2兆1,945億円(I 非競争入札:2,020億円) 5/14~2025/3/20 0.445% 按分32.3968% 平均0.434%

ETF買入 361億円 約定日 5/12

J-REIT買入 12億円 約定日 5/12

<< 5/13の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,116,600	前日比	36,400
O/N	0.06~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12
無担O/Nは0.06~0.07%前後での出会いが中心になると見込まれる。					

<< 12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158兆円(当座預金残高見込みは208兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、信託・地銀から0.06%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.065~0.067%の出会いと前日比横ばいで推移した。一巡後も同水準での散発的な出会いが見られる程度であった。

<< 12日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは低位横ばいでの推移となった。短国市場は6M物の入札が実施され、平均・按分落札利回共に▲0.006%となった。買入オペへの期待を背景に、事前予想よりも強めの結果となった。落札先が偏ったと見られることから、セカンドラリーでは▲0.017~▲0.015%での出会いも見られた。CP市場は目立った発行案件は見られなかったものの、発行件数がそれなりに見られたことで、発行総額は1,200億円程度となった。発行レートは概ね横ばいだった。

<< 13日の材料 >>

*佐藤日銀審議委員、FIAジャパン金融市場会議にて講演

*3月の国際収支 *4月の景気ウォッチャー調査

*米国3月の企業在庫 *米国4月の小売売上高

*ユーロ圏1-3月期のGDP速報値

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.12-14
0.450 0.060	19,624.84 3.93	為替(5時)	120.02-04

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	4/30	5/1	5/7	5/8	5/11	5/12
日銀当預残	2,102,200	2,089,700	2,047,700	2,083,900	2,090,300	2,080,200
準備預金残	1,907,700	1,894,800	1,861,700	1,896,200	1,903,700	1,894,700
レート	0.063%	0.068%	0.065%	0.068%	0.067%	0.067%
月中平均	0.06123%	0.06800%	0.06757%	0.06770%	0.06764%	0.06758%

「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録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