

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/5/15(金) <<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		18日需給予想		19日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		700	1,800	0		
財政		14,600	▲ 16,000	▲ 1,000		
資金過不足		15,300	▲ 14,200	▲ 1,000		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)			1,300	11,300		
67,672			▲ 1,800	▲ 13,600		
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		4,900		11,300		
CP等買入		▲ 800	▲ 300			
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				1,300		
ETF買入		400	400			
国債補充供給						
小計		4,500	▲ 400	30,300		
当増減		19,800	▲ 14,600	29,300		

当座預金残高	2,098,200	5/15以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	1,908,700		
積み終了先	1,591,800	5/18以降の残り所要積立額	
超過準備	1,591,800	積数	262,800
非準備先残高	189,500	1日平均	9,100
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,951,300		
5月の新所要見込	64,900	(一日平均)	

5/14のマネタリーベース		3,019,000	
5/14コール	合計 204,235	無担 78,269	有担 125,966
コール前日増減	計 ▲ 11,602	無担 ▲ 8,707	有担 ▲ 2,895

5/15の加重平均レート(速報)				5/14の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.050 ~0.125 (0.070)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.045 ~0.075 (0.068)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.058 ~0.120 (0.072)				T/N		0.058 ~0.125 (0.075)		
				S/N				
				1W		0.116 ~0.130 (0.123)		
0.118 (0.118)				2W				
				3W				
0.118 (0.118)		0.08-0.13	-	1M				有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.002-0.002	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

## <<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	5/19	~ 8/28 (101日間)	応札 11,251億円	落札 11,251億円	0.100%	全取	平均 0.100% (固定)
国債補完	8,000億円	5/15	~ 5/18 (3日間)	応札 28億円	落札 28億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国短買入	20,000億円	5/19		応札 35,589億円	落札 20,001億円	按分利回り較差 0.002%	95.1%	平均利回り較差 0.002%
国債買入	3,750億円	5/19		応札 12,216億円	落札 3,756億円	按分利回り較差 0.004%	61.5%	平均利回り較差 0.005%
国債買入	3,750億円	5/19		応札 14,916億円	落札 3,753億円	按分利回り較差 -0.011%	23.1%	平均利回り較差 -0.009%
国債買入	2,400億円	5/19		応札 5,519億円	落札 2,401億円	按分利回り較差 -0.043%	68.9%	平均利回り較差 -0.035%
国債買入	1,400億円	5/19		応札 3,066億円	落札 1,400億円	按分利回り較差 -0.038%	70.0%	平均利回り較差 -0.028%

被災地支援(第49回) 5/22~2016/5/20 (364日間) 貸付予定総額 0億円 貸付利率 0.10%

「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

<< 5/18の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,083,600	前日比	▲ 14,600
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1兆4,000億円増加の159兆3,000億円(当座預金残高見込みは209兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託より0.058~0.06%近辺の調達希望で始まったものの、調達側が取り上がる形となり、立ち上がりは0.07%を挟んだ出合いが中心となった。積み最終日と積み初日を挟んだ週末の取引となったことで小幅上昇で推移し、一巡後も概ね同水準での出合いが続いた。ターム物は、2W物の期間で大手行による調達が見られた。

<< 15日のオープン市場動向 >>  
現先レートS/Nは低位横ばいで推移した。短国市場は短国買入オペが2兆円度でオフアされた。週中に6M物と3M物の2本の入札があったことで、オフア額の増額期待もあったものの、前回と同額となった。6M物を中心に応札されたと見られ、結果は平均・按分利回り較差共に+0.002%、按分率95.1%となった。その他は、前場に3M物が▲0.002~0.001%の出合いが見られた程度で全般的に閑散だった。CP市場は小売業態で大型発行案件が見られたものの、発行件数が少なく発行総額は900億円程度となった。発行レートは概ね横ばいだった。

<< 18日の材料 >>  
\*3月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+1.8%)  
\*3月のマネタリーベース  
\*3月の第3次産業活動指数  
\*3月の石油等消費動態統計  
\*国庫短期証券入札(1年、25,000億円、5/20発行)

### <<コール4月積み期間分の加重平均レート>>

(土日を含む)	無担	0.06570%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06528%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	0.395	▲ 0.050	日経平均株価(終値)	19,732.92	162.68	為替(9時)	119.21-22
						為替(5時)	119.45-47

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	5/8	5/11	5/12	5/13	5/14	5/15
日銀当預残	2,083,900	2,090,300	2,080,200	2,115,300	2,078,400	2,098,200
準備預金残	1,896,200	1,903,700	1,895,300	1,926,600	1,889,600	1,908,700
レート	0.068%	0.067%	0.067%	0.068%	0.068%	0.070%
月中平均	0.06770%	0.06764%	0.06758%	0.06762%	0.06764%	0.06806%