

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/5/22(金) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	22日需給速報		25日需給予想		26日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,400		300		0
財政		▲ 1,400		▲ 15,200		11,000
資金過不足		▲ 2,800		▲ 14,900		11,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		7,300		2,800		7,200
68,529		▲ 3,600		▲ 2,500		▲ 3,900
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		11,900				
CP等買入						
		▲ 200		▲ 500		
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470						
被災地支援		3,244		0		
社債等買入				▲ 400		
ETF買入		200		200		
国債補充供給						
小計		15,600		▲ 400		3,300
当預増減		12,800		▲ 15,300		14,300

<< 5/25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	▲ 15,300
O/N	0.06~0.07	T/N	0.055~0.12	S/N	0.055~0.12

無担O/Nは0.06%台後半での出合いが中心になると見込まれる。

<< 22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6,000億円増の158兆9,000億円(当座預金残高見込みは209兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07~0.072%での調達、都銀からは0.068%での調達希望で始まった。週末要因により調達ニーズが強く、一巡後も、0.065~0.07%での出合いが見られ、終日底堅い展開のなか本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が数件見られた。

<< 22日のオープン市場動向 >>  
 短国現先レートS/Nは前日からほぼ変わらず。短国アウトライト市場では3M:0.002%、1Y:▲0.019~▲0.011%の出合いが見られた。CP市場は、ノンバンク業態からの大型発行案件が見られ、発行総額は1,100億円程度となった。発行レートは概ね横ばい圏での取引だった。

<< 25日の材料 >>  
 \*4月の貿易統計  
 \*日銀金融経済月報  
 \*米国祝日 (Memorial Day)  
 \*英国祝日 (Spring Bank Holiday)

当座預金残高	2,098,900	5/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,903,600		61,200
積み終了先	1,584,000	5/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,582,900	積数	37,100
非準備先残高	195,300	1日平均	1,700
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	2,010,600		
準備預金進捗率	98.15% (実績)	29.03% (日数)	

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)		121.05-06
0.410	0.000	20,264.41	61.54	為替(5時)		120.72-75

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	5/15	5/18	5/19	5/20	5/21	5/22
日銀当預残	2,098,200	2,082,800	2,118,200	2,110,100	2,086,100	2,098,900
準備預金残	1,908,700	1,896,200	1,927,100	1,914,100	1,890,900	1,903,600
レート	0.070%	0.068%	0.069%	0.069%	0.070%	0.072%
月中平均	0.06806%	0.06806%	0.06811%	0.06815%	0.06824%	0.06871%

5/21のマネタリーベース				3,025,400		
5/21コール	合計	195,586	無担	67,674	有担	127,912
コール前日増減	計	1,988	無担	1,898	有担	90

5/22の加重平均レート(速報)				5/21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	
0.050	~0.078 (0.072)	0.030	~0.040 (0.031)			0.050	~0.120 (0.070)			0.030	~0.040 (0.031)
0.058	~0.125 (0.078)							0.059	~0.125 (0.079)		
0.123	(0.123)										
								0.064	~0.117 (0.111)		
0.180	~0.310 (0.202)							0.160	(0.160)		
				0.08-0.13	-	1M		0.145	(0.145)	有担先日付分	
				0.08-0.12	-	2M					
				0.08-0.12	0.002	3M					
				-	-	6M					
				-	▲0.019-▲0.011	1Y					

## <<オペ情報、入札結果>>

全店共通 15,000億円 5/26 ~ 9/4 (101日間) 応札 7,210億円 落札 7,210億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 ETF買入 361億円 約定日 5/22

「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す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