CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/5/27(水)　≪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	29日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	▲ 1,300	▲ 900
財政		0	▲ 14,400	200
資金過不足		▲ 900	▲ 15,700	▲ 700
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 72,268				7,200 ▲ 4,700
国債買現 0				
CP買現 0				
国庫短期証買入		22,500		
国庫短期証売却				
国債買入		11,600		7,800
CP等買入		▲ 300	▲ 300	2,500
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470				
被災地支援 3,244				
社債等買入		▲ 300	▲ 100	
ETF買入		200	300	
国債補完供給		100		
小計		33,800	▲ 100	12,800
当預増減		32,900	▲ 15,800	12,100

当座預金残高	2,135,700	5/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,942,400		25,300
積み終了先	1,629,800	5/28以降の残り所要積立額	
超過準備	1,629,600	積数	21,800
非準預先残高	193,300	1日平均	1,100
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　98.92%　(実績)　38.71%　(日数)

5/26のマネタリーベース				3,043,600		
5/26コール	合計	192,731	無担	64,706	有担	128,025
コール前日増減	計	▲ 8,373	無担	▲ 5,105	有担	▲ 3,268

≪ 5/28の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,119,900	前日比	▲ 15,800
O／N	0.06～0.075	T／N	0.055～0.12	S／N	0.055～0.12

無担O/Nは0.07%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3兆6,000億円増の163兆5,000億円(当座預金残高見込みは過去最高の213兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07～0.072%での調達で始まった。当座預金残高が再び過去最高額を更新したものの、調達姿勢に大きな変化はなく、その後も0.07%近辺での出合いが見られるなか本日の取引を終えた。また、一部では0.13%での試し取りが数件程見られた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

≪ 27日のオープン市場動向 ≫

現先レートS/Nは、横ばい圏で推移した。短国市場は、アウトライトで1Y:▲0.024%の出合いが見られた程度で、28日の3M物入札を控えて閑散であった。CP市場は、配当や賞与に備えた資金調達とみられる入札が数多く実施された。入札総額は、7,700億円程度と大きく膨らんだものの、発行レートは概ね横ばいであった。

≪ 28日の材料 ≫

*4月の商業動態統計速報
*英国1-3月期のGDP改定値
*国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、6/1発行)
*2年利付国債入札(25,000億円、6/15発行)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	122.99-00
0.390	▲ 0.035	20,472.58	35.10	為替(5時)	122.98-01

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	5/20	5/21	5/22	5/25	5/26	5/27
日銀当預残	2,110,100	2,086,100	2,098,900	2,083,600	2,102,800	2,135,700
準備預金残	1,914,100	1,890,900	1,903,600	1,894,700	1,913,100	1,942,400
レート	0.069%	0.070%	0.072%	0.069%	0.071%	0.074%
月中平均	0.06815%	0.06824%	0.06871%	0.06872%	0.06881%	0.06900%

5/27 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 ～0.130 (0.074)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N
0.067 ～0.130 (0.091)				T/N
0.122 (0.122)				S/N
0.067 ～0.122 (0.089)				1W
0.116 ～0.310 (0.162)				2W
				3W
0.260 (0.260)		0.08-0.13	－	1M
		0.08-0.12	－	2M
		0.08-0.12	－	3M
		－	－	6M
		－	▲0.024	1Y

5/26 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
0.055 ～0.080 (0.071)		0.030 ～0.040 (0.031)
	0.058 ～0.120 (0.074)	
	0.075 ～0.200 (0.084)	
	0.145 (0.145)	
		有担先日付分

≪オペ情報、入札結果≫

全店共通	15,000億円	5/29	～ 9/8	(102日間)	応札	7,160億円	落札	7,160億円	0.100%	全 取	平 均 0.100% (固定)
国債補完	4,467億円	5/27	～ 5/28	(1日間)	応札	39億円	落札	39億円	-0.400%	全 取	平 均 -0.400% (即)
国債買入	4,000億円	5/29	応札	11,277億円	落札	4,008億円	按分利回り較差		-0.017%	37.3%	平均利回り較差 -0.015%
国債買入	2,400億円	5/29	応札	4,657億円	落札	2,402億円	按分利回り較差		-0.025%	21.7%	平均利回り較差 -0.017%
国債買入	1,400億円	5/29	応札	3,910億円	落札	1,402億円	按分利回り較差		-0.013%	62.1%	平均利回り較差 -0.008%

米ドル資金供給(固定金利方式)　5/29～6/4 (6日間) 応札なし　貸付利率 0.610%

交付税特会　1兆500億円　6/4～12/3　応札3兆4,240億円 落札1兆500億円　0.082% 按分92.0000% 平均0.081%

J-REIT買入　12億円　約定日 5/27

「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