

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/4/4(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	4日需給速報		7日需給予想	8日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,100	1,900	2,000
財政		2,700	▲ 13,400	1,000
資金過不足		3,800	▲ 11,500	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,100	15,200	
135,690		▲ 3,300	▲ 18,000	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				15,000
国庫短期証売却				
国債買入		9,100		6,100
CP等買入				
		▲ 200	▲ 600	
貸出支援基金				
(成長) 33,429				
(増加) 85,512				
被災地支援				
3,805				
社債等買入				
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		7,700	▲ 3,300	21,100
当預増減		11,500	▲ 14,800	24,100

《 4/7の日銀調節とレート予想 》

日銀調節	見送り	当座預金残高	1,274,500	前日比	▲ 14,800
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.06%前後の出合いが中心となるであろう。

無担O/Nは0.06%前後の出合いが中心となるであろう。

4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は、前日比7,000億円増の99兆2,000億円(当座預金残高見込は129兆円)。本日の無担O/Nは、地銀業態から0.06%付近での調達、大手行・信託・証券業態からは0.06%前後での調達希望で始まった。出合い一巡後もビッドレートは底堅く、0.06~0.065%で散発的に出合うなか、本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態の調達となる、ロール案件が見られた程度。

4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、短国買入オペが実施され、按分落札利回較差0.005%、按分率52.9%、平均落札利回較差0.006%と、調整売りが見られたことから小甘い結果になった。アウトライト市場では、1M:0.035%、3M:0.049~0.051%、1Y:0.04%で出合っており、3M物以外は小額での出合いであった。C/P市場は、発行総額1,000億円程度(入札ベース)。発行レートは、0.08%台が中心であった。

7日の材料

- *3月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、8日まで)
- *2月の景気動向指数速報
- *米国2月の消費者信用残高
- *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、4/10発行)

《コール3月の加重平均レート》

(土日を含む)	無担	0.07194%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07210%	有担	0.04100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	103.89-91
0.640	0.000	15,063.77	▲ 8.11	為替(5時)	103.90-91

○/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	3/28	3/31	4/1	4/2	4/3	4/4
日銀当預残	1,282,000	1,286,700	1,297,800	1,302,500	1,277,800	1,289,300
準備預金残	1,172,000	1,195,000	1,178,500	1,190,100	1,164,100	1,172,400
レート	0.069%	0.044%	0.065%	0.064%	0.064%	0.066%
月中平均	0.07287%	0.07194%	0.06500%	0.06450%	0.06433%	0.06517%

4/4 の加重平均レート(速報)

無担 (平均)	有担 (平均)	CP 氮配a-1	
0.050 ~0.145 (0.066)	0.040 ~0.050 (0.041)		
0.055 ~0.130 (0.081)			
0.150 ~0.400 (0.218)			
0.118 ~0.200 (0.159)		0.08-0.13	
		0.08-0.13	
0.118 (0.118)		0.08-0.13	0.0
		-	
		-	

4/3 の加重平均レート(確報)

	無担当日分	無担当先日付分	有担当日分
O/N	0.050 ~0.145 (0.064)		0.040 ~0.050 (0.041)
T/N		0.081 ~0.120 (0.101)	
S/N			
1W		0.065 (0.065)	
2W		0.340 (0.340)	
3W			
1M			有担当先日付分
2M			
3M			
6M			
1Y			

《オペ情報、入札結果》

国短買入	15,000億円	4/8	応札	35,525億円	落札	15,006億円	按分利回り較差	0.005%	52.9%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	1,100億円	4/8	応札	6,007億円	落札	1,104億円	按分利回り較差	0.003%	10.0%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,500億円	4/8	応札	11,466億円	落札	2,501億円	按分利回り較差	0.005%	90.8%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,500億円	4/8	応札	13,251億円	落札	2,503億円	按分利回り較差	0.005%	93.3%	平均利回り較差	0.006%
交付税特会 J-REIT買入	1兆500億円 3億円 約定日 4/4	4/16～10/16	応札	3兆880億円	落札	1兆500億100万円	0.100%	按分	57.5698%	平均	0.099%

「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。