

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/4/15(火) <<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		16日需給予想		17日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		700	0	▲ 1,000		
財政		21,000	1,900	▲ 25,000		
資金過不足		21,700	1,900	▲ 26,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		11,800		3,300		
127,928		▲ 15,000		▲ 1,700		
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			3,100			
CP等買入						
		▲ 300	▲ 500			
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				900		
ETF買入		100	100			
国債補完供給						
小計		▲ 3,400	17,700	2,500		
当預増減		18,300	19,600	▲ 23,500		

当座預金残高	1,319,400	4/15以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,217,600		600
積み終了先	1,027,400	4/16以降の残り所要積立額	
超過準備	1,026,800	積数	1,842,000
非準預先残高	101,800	1日平均	61,400
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)			1,884,300

4月の新所要見込 61,400 (一日平均)

4/14のマネタリーベース		2,202,400	
4/14コール	合計	141,596	無担 44,119 有担 97,477
コール前日増減	計	591	無担 1,566 有担 ▲ 975

4/15の加重平均レート(速報)			4/14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 ~0.145 (0.064)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.055 ~0.125 (0.065)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.060 ~0.125 (0.090)				T/N	0.060 ~0.125 (0.085)	
				S/N		
0.117 ~0.200 (0.151)				1W	0.108 ~0.260 (0.119)	
0.116 ~0.118 (0.118)				2W	0.118 ~0.180 (0.121)	
				3W		
0.245 (0.245)		0.08-0.13	-	1M	0.195 (0.195)	0.118 ~0.145 (0.119)
		0.08-0.13	-	2M		
		0.08-0.13	0.058-0.060	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 4/17 ~ 7/22 (96日間) 応札 3,301億円 落札 3,301億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 4/17~4/24 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.580%
 5年利付国債(表面利率0.2%) 応札11兆4,866億円 落札2兆4,607億円(1非競争入札:2,374億円) 4/17~2019/3/20 0.191% 按分42.6809% 平均0.189%

<< 4/16の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,339,000	前日比	19,600
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは、0.065%前後の出合いが中心となるであろう。

<< 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は、前営業日比1兆6,000億円増の10兆8,000億円(当座預金残高見込は132兆円)。本日の無担O/Nは、信託・証券業態で0.06~0.065%、大手行・地銀業態からは0.06%前後での調達で始まった。積み最終日であったが、財政等要因により大幅な余剰日となった事で、終日落ち着いた取引となった。ターム物は、大手行から2W物0.118%でまとまった調達が見られた。

<< 15日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは引き続き小高く推移。短国アウトライト市場は足元金利が高い中、全般的に様子見姿勢。3Mで0.058~0.06%の出合いが見られた。CP市場は1,000億円程度の発行。現先レートが上昇しているものの、CP発行レートは概ね横ばい圏で推移。

<< 16日の材料 >>

- *黒田日銀総裁、第89回信託大会にて挨拶
- *2月の石油等消費動態統計
- *ECB定例理事会(金融政策発表なし)
- *ユーロ圏3月の消費者物価指数改定値
- *米国ページブック *米国3月の住宅着工件数
- *米国3月の鉱工業生産・設備稼働率
- *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、4/21発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、4/24借入)

<<コール3月積み期間分の加重平均レート>>

(土日を含む)	無担	0.06768%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06714%	有担	0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.91-93
0.600	-	為替(5時)	101.79-80

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	4/8	4/9	4/10	4/11	4/14	4/15
日銀当預残	1,301,100	1,305,900	1,300,200	1,301,500	1,301,100	1,319,400
準備預金残	1,184,400	1,188,900	1,183,300	1,183,000	1,187,200	1,217,600
レート	0.065%	0.064%	0.065%	0.065%	0.065%	0.064%
月中平均	0.06513%	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06493%

「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