

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/4/24(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	24日需給速報 即日 金額	25日需給予想 金額	28日当社予想 金額
銀行券	▲ 3,300	▲ 3,200	▲ 3,000
財政	▲ 11,900	8,500	▲ 5,000
資金過不足	▲ 15,200	5,300	▲ 8,000
貸出			
売出手形 0			
本店共通 0			
全店共通 0			
共通(固定) 128,011			6,000 ▲ 3,200
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		6,800	
CP等買入			
	▲ 100	▲ 1,000	
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512			
被災地支援 3,806	0		
社債等買入		▲ 200	
ETF買入			
国債補充供給			
小計	▲ 100	5,600	2,800
当預増減	▲ 15,300	10,900	▲ 5,200

当座預金残高	1,328,800	4/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,214,700		66,600
積み終了先	1,019,800	4/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,017,900	積数	56,400
非準備先残高	114,100	1日平均	2,700
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)			1,842,000
準備預金進捗率	96.94% (実績)	30.00% (日数)	

4/23のマナタリーベース	2,250,200
4/23コール 合計	165,080 無担 66,136 有担 98,944
コール前日増減 計	3,214 無担 1,960 有担 1,254

4/24 の加重平均レート(速報)				4/23 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	有担先日付分	
0.050 ~0.075 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.050 ~0.125 (0.065)			0.040 ~0.050 (0.041)	
0.070 ~0.120 (0.077)				T/N	0.065 ~0.120 (0.083)			
				S/N				
0.200 (0.200)				1W	0.130 (0.130)			
0.114 ~0.340 (0.126)				2W	0.118 (0.118)			
0.116 (0.116)				3W				
0.090 (0.090)		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分	
		0.08-0.13	0.065-0.07	2M				
		0.08-0.13	0.064-0.07	3M				
		-	-	6M				
		-	0.0400	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 4/28 ~ 7/28 (91日間) 応札 6,010億円 落札 6,010億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 CP買入 4,500億円 4/30 応札 8,105億円 落札 4,190億円 按分レート 0.087% 25.9% 平均落札レート 0.089%
 T-Bill3M 応札26兆8,642億円 落札5兆2,456億3,000万円(非競争入札:4,743億円) 4/28~7/28 0.0661% 按分28.9038% 平均 0.0637%
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札14兆6,271億円 落札2兆4,786億円(I 非競争入札:2,190億円) 5/15~2016/5/15 0.089% 按分51.3075% 平均 0.089%
 交付税特会 1兆500億円 5/9~2016/5/15 応札 3兆1,709億円 落札 1兆500億円 0.100% 按分 80.7695% 平均 0.100%
 ETF買入 116億円 約定日 4/24

「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

4/25の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,339,700	前日比	10,900
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%近辺での出合いが中心となるであろう。					

<< 24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、101兆9,000億円。無担O/Nは地銀、信託業態から0.06~0.065%、大手行、都銀からは0.06%での調達希望。昨日に続き一部の大手行が0.065%のをオファーをデイクンした為、出合いの中心は0.065%となり、こじっかりとした立ち上がりとなった。一巡後も調達レートは低下せず、0.065%中心の散発的な出合いが見られた。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが若干見られる程度であった。

<< 24日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは0.09~0.10%程度。短国の発行日にあたったことで、調達希望はしっかりだったが、0.10%を超える水準では運用希望が厚く、レートは高め水準で横ばいとなった。短国アウトライト市場は2M:0.065~0.07%、3M:0.064~0.07%、1Y:0.04%の出合い。短国3M物の入札が実施され、按分落札利回り0.0661%、按分比率28.9038%、平均落札利回り0.0637%となり、先週と比べて甘めの結果となった。CP市場は月末の前倒し発行があり、発行総額3,700億円程度。CP等買入オペが実施され、按分レート0.087%、平均レート0.089%、按分比率25.9%という結果になった。発行レートが上昇基調であるため、オペ結果も前回対比で若干レート上昇となっている。

<< 25日の材料 >>

*3月全国・4月都都区消費者物価指数(CPI)

市場予想: 全国(3月)前年同月比(除く生鮮): +1.4%

東京都都部(4月)前年同月比(除く生鮮): +2.8%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.49-50
0.615	0.005	14,404.99	▲ 141.28
		為替(5時)	102.39-40

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	4/17	4/18	4/21	4/22	4/23	4/24
日銀当預残	1,315,700	1,325,200	1,306,800	1,346,000	1,344,100	1,328,800
準備預金残	1,192,800	1,203,100	1,182,800	1,212,900	1,221,300	1,214,700
レート	0.064%	0.065%	0.065%	0.065%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06482%	0.06485%	0.06486%	0.06486%	0.06487%	0.06488%