

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/4/25(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	25日需給速報 即日 金額	28日需給予想 金額	30日当社予想 金額
銀行券	▲ 3,400	▲ 2,100	▲ 3,500
財政	8,500	▲ 4,600	7,000
資金過不足	5,100	▲ 6,700	3,500
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)		6,000	
128,011		▲ 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		3,100
CP等買入			4,200
	▲ 1,000	▲ 600	
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512			
被災地支援			
3,806			
社債等買入	▲ 200		
ETF買入			
国債補完供給			
小計	5,600	2,200	7,300
当預増減	10,700	▲ 4,500	10,800

当座預金残高	1,339,500	4/25以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,219,000		56,400
積み終了先	1,027,000	4/28以降の残り所要積立額	
超過準備	1,024,100	積数	33,300
非準備先残高	120,500	1日平均	1,800
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	98.19% (実績)	40.00% (日数)	

4/24のマネタリーベース		2,238,300	
4/24コール	合計	157,863	無担 59,468 有担 98,395
コール前日増減	計	▲ 7,217	無担 ▲ 6,668 有担 ▲ 549

4/25 の加重平均レート(速報)				4/24 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	
0.060 ~0.075 (0.067)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N	0.050 ~0.075 (0.065)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.066 ~0.120 (0.082)				T/N		0.070 ~0.120 (0.077)		
				S/N				
0.116 ~0.400 (0.161)				1W		0.200 (0.200)		
0.118 ~0.180 (0.127)				2W		0.114 ~0.340 (0.126)		
				3W		0.116 (0.116)		
0.118 (0.118)		0.08-0.13	-	1M		0.090 (0.090)	有担先日付分	
		0.08-0.13	0.0650	2M				
		0.08-0.13	0.0650	3M				
		-	0.0400	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債買入	1,700億円	4/30	応札	5,731億円	落札	1,707億円	按分利回り較差	0.011%	52.4%	平均利回り較差	0.012%
国債買入	1,400億円	4/30	応札	6,902億円	落札	1,403億円	按分利回り較差	-0.17円	33.7%	平均利回り較差	-0.245円
J-REIT買入	3億円	約定日	4/25								

「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

《 4/28の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,335,000	前日比	▲ 4,500
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12
無担O/Nは0.06~0.07%近辺での出合いが中心となるであろう。					

《 25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、103兆9,000億円。朝方の無担O/Nは大手行、地銀、信託業態から0.065%での調達希望。一部で0.068%での出合いも見られるなど、やや強めの立ち上がりとなった。一巡後も大手行が0.065%の取り気配を示していた為、一日を通して底堅い地合いであった。ターム物に関しては、大手行が1M物0.118%で調達を行った。

《 25日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは、前日から変わらず0.09~0.10%程度。短国アウトライト市場は2M:0.065%、3M:0.065%、6M:0.04%の出合い。短国買入オペが見送られたが、様子見の参加者が多く、取引は閑散。CP市場は月末受渡にあたり、発行総額6,500億円程度。前日のCP等買入オペの影響から一部に積極的な応札姿勢も見られたが、現先レートは高止まりしており、全体としては発行レートも高めの印象。

《 28日の材料 》

*3月の商業販売統計速報

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	102.30-32
0.620	0.005	14,429.26	24.27	為替(5時)	102.27-29

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	4/18	4/21	4/22	4/23	4/24	4/25
日銀当預残	1,325,200	1,306,800	1,346,000	1,344,100	1,328,800	1,339,500
準備預金残	1,203,100	1,182,800	1,212,900	1,221,300	1,214,700	1,219,000
レート	0.065%	0.065%	0.065%	0.065%	0.065%	0.067%
月中平均	0.06485%	0.06486%	0.06486%	0.06487%	0.06488%	0.06511%