

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/5/22(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	22日需給速報 即日 金額	23日需給予想 金額	26日当社予想 金額
銀行券	▲ 1,900	▲ 1,200	1,000
財政	▲ 10,300	27,600	▲ 16,000
資金過不足	▲ 12,200	26,400	▲ 15,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)			2,500
126,874			▲ 2,200
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			
CP等買入	3,800 ▲ 400	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512			
被災地支援		0	
3,806		0	
社債等買入		▲ 300	
ETF買入	100	100	
国債補完供給			
小計	3,500	▲ 500	300
当増減	▲ 8,700	25,900	▲ 14,700

当座預金残高	1,313,800	5/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,189,600		163,900
積み終了先	994,000	5/23以降の残り所要積立額	
超過準備	986,800	積数	139,900
非準備先残高	124,200	1日平均	5,800
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)			1,892,400
準備預金進捗率	92.61% (実績)	22.58% (日数)	

5/21のマネタリーベース	2,222,800
5/21コール 合計	176,186 無担 79,817 有担 96,369
コール前日増減 計	10,324 無担 11,570 有担 ▲ 1,246

5/22 の加重平均レート(速報)				5/21 の加重平均レート(確報)				単位 (%)
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-I	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分		
0.055 ~0.135 (0.067)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N	0.050 ~0.135 (0.089)	0.040 ~0.050 (0.041)		
0.120 (0.120)				T/N				
				S/N	0.120 (0.120)			
0.117 ~0.170 (0.126)				1W	0.089 ~0.130 (0.112)			
0.118 ~0.340 (0.129)				2W	0.118 (0.118)			
				3W				
0.118 ~0.150 (0.120)		0.08-0.13	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分		
		0.08-0.13	-	2M				
		0.08-0.13	0.030~0.041	3M				
		-	0.0310	6M				
		-	0.0340	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 5/26 ~ 8/18 (84日間) 応札 2,500億円 落札 2,500億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札27兆5,085億円 落札5兆2,349億3,000万円(非競争入札:4,250億円) 5/26~8/25 0.0401% 按分31.0426% 平均0.0389%
 流動性供給 応札 1兆4,994億円 落札 3,997億円 5/26 募入最大利回較差 ▲0.003% 按分 92.6365% 募入平均利回較差 ▲0.004%

「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

5/23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	25,900
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12
無担O/Nは0.06~0.065%程度での出合いが中心となろう。					

<< 22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1,000億円増加の100兆9,000億円(当座預金残高見込みは131兆3,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06%程度、地銀および信託業態から0.065%前後のビッドが見られた。一巡後の出合いは、0.065%前後で推移した。午後は調整の動きが若干見られた程度で、本日の取引を終えた。ターム物は大手行が1W物を0.117%、2W物および1M物を0.118%でビッドし、まとまった出合いが見られた。

<< 22日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは、短国の発行日であることから高めの推移となった。短国市場は、新発3M物の入札が実施された。W I取引で3M:0.034~0.041%で出合いが見られる中、最高落札利回り0.0401%、按分率31.0426%、平均落札利回り0.0389%という結果となった。入札後にはショートカバーから0.030%まで買われる場面もあった。その他には、6M:0.031%、1Y:0.034%での出合いが見られた。CP市場は、鉄鋼・ノンバンク業態からまとまった発行が実施され、総額1,400億円程度の発行。発行レートは、概ね横ばいであった。

<< 23日の材料 >>

*月例経済報告

*米国4月の新築一戸建て販売件数

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.43-44
0.600 0.010	14,337.79 295.62	為替(5時)	101.54-55

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	5/15	5/16	5/19	5/20	5/21	5/22
日銀当預残	1,345,300	1,345,000	1,293,100	1,288,900	1,322,500	1,313,800
準備預金残	1,222,500	1,214,200	1,179,400	1,162,200	1,185,600	1,189,600
レート	0.065%	0.067%	0.067%	0.067%	0.089%	0.067%
月中平均	0.06580%	0.06600%	0.06605%	0.06610%	0.06719%	0.06718%