

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/5/23(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	23日需給速報 即日 金額	26日需給予想 金額	27日当社予想 金額
銀行券	▲ 1,100	700	1,000
財政	26,100	▲ 16,100	15,000
資金過不足	25,000	▲ 15,400	16,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)		2,500	5,400
126,874		▲ 2,200	▲ 12,600
国債買現			
0			
CP買現			
0			
国庫短期証買入			20,000
国庫短期証売却			
国債買入			6,700
CP等買入			
	▲ 300	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512			
被災地支援	0		
3,782	0		
社債等買入	▲ 300		
ETF買入	100	100	
国債補完供給			
小計	▲ 500	200	19,500
当増減	24,500	▲ 15,200	35,500

当座預金残高	1,338,300	5/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,209,100		139,900
積み終了先	1,015,900	5/26以降の残り所要積立額	
超過準備	1,014,000	積数	95,900
非準預先残高	129,200	1日平均	4,600
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	94.93% (実績)	32.26% (日数)	

5/22のマネタリーベース	2,215,900
5/22コール 合計	168,458 無担 71,443 有担 97,015
コール前日増減 計	▲ 7,728 無担 ▲ 8,374 有担 646

5/23 の加重平均レート(速報)				5/22 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	有担先日付分	
0.050 ~0.135 (0.068)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N	0.055 ~0.135 (0.067)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.065 ~0.120 (0.081)				T/N		0.120 (0.120)		
				S/N				
				1W	0.170 (0.170)	0.117 (0.117)		
				2W		0.118 ~0.340 (0.125)		
				3W				
0.118 (0.118)		0.08-0.13	-	1M		0.118 ~0.150 (0.119)	有担先日付分	
		0.08-0.13	0.0370	2M				
		0.08-0.13	0.036~0.037	3M				
		-	-	6M				
		-	0.032~0.035	1Y				

《オペ情報、入札結果》

全店共通	15,000億円	5/27	～	9/5 (101日間)	応札	5,420億円	落札	5,420億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国短買入	20,000億円	5/27	応札	44,924億円	落札	20,006億円	按分利回り較差	0.000%	49.3%	平均利回り較差	0.001%	
国債買入	2,500億円	5/27	応札	15,569億円	落札	2,514億円	按分利回り較差	0.003%	8.0%	平均利回り較差	0.004%	
国債買入	2,500億円	5/27	応札	13,126億円	落札	2,500億円	全取利回り較差	0.004%		平均利回り較差	0.004%	
国債買入	1,700億円	5/27	応札	5,291億円	落札	1,707億円	按分利回り較差	0.011%	50.1%	平均利回り較差	0.012%	

「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 日本証券協会加入

《 5/26の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,323,100	前日比	▲ 15,200
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。					

《 23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2兆7,000億円増加の103兆6,000億円(当座預金残高見込みは134兆円)。無担O/Nは大手行から0.06～0.065%、地銀および信託業態から0.065～0.07%のビッドが見られた。一巡後の出合いは、0.065～0.068%程度で推移した。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1M物を0.118%でビッドし、まとまった出合いが見られた。

《 23日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは、短国買入オペがオファーされた後、低下して推移した。短国買入オペは20,000億円でオファーされ、按分利回り較差±0.000%、平均利回り較差+0.001%、按分率49.3%と予想通りの結果であった。アウトライト市場は、金利の絶対水準が下限域であることから様子見姿勢の参加者が多く、2M:0.037%、3M:0.036～.037%、1Y:0.032～0.035%の出合いと小甘い展開。CP市場は、様々な業態から発行が実施され、発行総額1,000億円程度。発行期間は、ノンバンク業態を除くと、期内物の償還が中心であった。

《 26日の材料 》

- *日銀金融政策決定会合議事要旨(4月30日開催分)
- *岩田日銀副総裁、共同通信加盟社論説研究会にて講演
- *メモリアルデー(米国市場休場)
- *スプリング・バンクホリデー(英国市場休場)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.77-79
0.590 ▲ 0.010	14,462.17 124.38	為替(5時)	101.72-73

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	5/16	5/19	5/20	5/21	5/22	5/23
日銀当座預金	1,345,000	1,293,100	1,288,900	1,322,500	1,313,800	1,338,300
準備預金残	1,214,200	1,179,400	1,162,200	1,185,600	1,189,600	1,209,100
レート	0.067%	0.067%	0.067%	0.089%	0.067%	0.068%
月中平均	0.06600%	0.06605%	0.06610%	0.06719%	0.06718%	0.06728%