

2014/5/27(火)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	27日需給速報		28日需給予想		29日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		400	0	▲ 1,000		
財政		14,500	▲ 300	▲ 2,000		
資金過不足		14,900	▲ 300	▲ 3,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		5,400	1,400			
119,984		▲ 12,600	▲ 3,300			
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		6,800	4,300			
CP等買入		▲ 200	▲ 400			
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512						
被災地支援						
3,782						
社債等買入		▲ 100				
ETF買入						
国債補完供給						
小計		19,300	2,000	0		
当預増減		34,200	1,700	▲ 3,000		

当座預金残高	1,356,700	5/27以降の残り所要積立額	81,800
準備預金残高	1,228,000		
積み終了先	1,036,000	5/28以降の残り所要積立額	68,300
超過準備	1,035,100	積数	3,600
非準備先残高	128,700	1日平均	3,600
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	96.39% (実績)	38.71% (日数)	

5/26のマナターベース		2,225,300	
5/26コール	合計	165,801	無担 67,872 有担 97,929
コール前日増減	計	▲ 4,229	無担 ▲ 4,820 有担 591

5/27の加重平均レート(速報)				5/26の加重平均レート(確報)			
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
0.045 ~0.135 (0.066)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.050 ~0.135 (0.068)			0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.120 (0.075)				T/N	0.065 ~0.120 (0.099)		
				S/N			
0.073 ~0.200 (0.107)				1W	0.117 ~0.400 (0.166)		
				2W	0.118 (0.118)		
				3W			
0.118 (0.118)		0.08-0.13	-	1M	0.090 (0.090)	有担先日付分	
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.0370-0.0380	3M	0.118 (0.118)		
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

《オペ情報、入札結果》

CP買入 4,000億円 5/30 応札 10,265億円 落札 3,730億円 按分レート 0.088% 40.7% 平均落札レート 0.090%
 40年利付国債(表面利率1.7%) 応札 1兆4,912億円 落札 3,995億円 5/29~2054/3/20 1.790% 按分 29.7674%

《 5/28の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,358,400	前日比	1,700
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。

《 27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3兆4,000億円増加の105兆3,000億円(当座預金残高見込みは135兆7,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06%、地銀および信託業態から0.06~0.065%程度のビッドが見られた。一巡後の出合いは、0.061~0.062%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。

《 27日のオープン市場動向 》
 現先取引S/Nは前日同水準で推移。短国市場は3M物で0.037~0.038%の出合いが見られた程度で、動意に乏しい地合いであった。CP発行市場は月末前倒し発行分も加わり、発行総額は2,100億円弱。レート水準は概ね横ばい圏であった。CP等買入オペアは一部売却意欲の強い銘柄があったためか、それぞれの利回りは平均0.090%・按分0.088%と前回(0.088%・0.085%)から上昇した。

《 28日の材料 》
 *黒田日銀総裁、2014年国際コンファランス「金融危機後の金融政策」にて講演
 *交付税特別会計借入(10,500億円、6/5発行)

JGB新発10年債	0.590	0.000	日経平均株価(終値)	14,636.52	34.00	為替(9時)	101.91-92
						為替(5時)	101.76-77

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	5/20	5/21	5/22	5/23	5/26	5/27
日銀当預残	1,288,900	1,322,500	1,313,800	1,338,300	1,322,500	1,356,700
準備預金残	1,162,200	1,185,600	1,189,600	1,209,100	1,199,800	1,228,000
レート	0.067%	0.089%	0.067%	0.068%	0.068%	0.066%
月中平均	0.06610%	0.06719%	0.06718%	0.06728%	0.06731%	0.06726%

「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