

2014/5/30(金) <セントラル短資株式会社>

<資金需給>

単位 億円

	30日需給速報		2日需給予想	3日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	1,400	1,000
財政		900	▲ 20,400	▲ 7,000
資金過不足		500	▲ 19,000	▲ 6,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			3,400	
118,064			▲ 3,400	
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		9,000
CP等買入		3,700		
		▲ 2,800	▲ 800	
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	▲ 100	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		7,600	▲ 900	29,000
当預増減		8,100	▲ 19,900	23,000

当座預金残高	1,362,600	5/30以降の残り所要積立額	47,500
準備預金残高	1,238,900		
積み終了先	1,059,800	6/2以降の残り所要積立額	
超過準備	1,058,500	積数	29,600
非準預先残高	123,700	1日平均	2,100
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	1,891,600		
準備預金進捗率	98.44% (実績)	54.84% (日数)	

5/29のマナリーベース		2,257,800	
5/29コール	合計	162,966 無担	65,281 有担
コール前日増減	計	▲ 3,377 無担	▲ 1,833 有担

6/2の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,342,700	前日比	▲ 19,900
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。					

< 30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1兆4,000億円増加の105兆9,000億円(当座預金残高見込みは136兆3,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06~0.068%程度、地銀および信託業態から0.065~0.07%程度のビッドが見られた。一巡後の出合いは、0.065~0.07%程度で底堅く推移した。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。

< 30日のオープン市場動向 >

現先取引S/Nは昨日の短国発行を受けてやや上昇。短国市場は0.051%の出合いが見られるなか、短国買入オペが2兆円でオファーされたことで若干目線を下げ、0.05%を割る水準へ推移した。なお買入オペの結果は平均利回較差+0.002%・按分利回較差±0%と落ち着いた水準であった。CP発行市場は複数の石油業態から発行が見られたこともあり、発行総額1,700億円程度。発行レートは若干上昇した。

< 2日の材料 >

- *1-3月期の法人企業統計調査季報
- *5月実績/6月見込み財政資金対民間収支
- *米国4月の建設支出 *米国5月のISM製造業景況指数

<コール5月の加重平均レート>

(土日を含む)	無担	0.06739%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06760%	有担	0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.72-73
0.570 ▲ 0.005	14,632.38 ▲ 49.34	為替(5時)	101.63-64

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	5/23	5/26	5/27	5/28	5/29	5/30
日銀当預残	1,338,300	1,322,500	1,356,700	1,357,800	1,354,500	1,362,600
準備預金残	1,209,100	1,199,800	1,228,000	1,230,900	1,224,700	1,238,900
レート	0.068%	0.068%	0.066%	0.065%	0.070%	0.069%
月中平均	0.06728%	0.06731%	0.06726%	0.06718%	0.06728%	0.06739%

5/30の加重平均レート(速報)				5/29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	有担当日分	無担先日付分	有担先日付分	
0.060 ~0.135 (0.069)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.135 (0.070)			0.040 ~0.050 (0.041)	
0.061 ~0.120 (0.094)				T/N		0.065 ~0.120 (0.081)		
				S/N				
				1W	0.170 (0.170)	0.105 (0.105)		
				2W		0.118 (0.118)		
				3W				
		0.08-0.13	-	1M		0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.13	-	2M				
		0.08-0.13	0.0450-0.0510	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<オペ情報、入札結果>

国短買入	20,000億円	6/3	応札	41,847億円	落札	20,006億円	按分利回り較差	0.000%	15.7%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	2,500億円	6/3	応札	12,058億円	落札	2,512億円	按分利回り較差	0.003%	23.2%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,500億円	6/3	応札	10,468億円	落札	2,504億円	按分利回り較差	0.003%	37.1%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	4,000億円	6/3	応札	12,370億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	0.006%	43.4%	平均利回り較差	0.007%

成長基盤強化(本則第16回) 6/6~2018/6/4 (1,459日間) 貸付予定総額 4,172億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 71先
 成長基盤強化(本則第12回の借り換え) 6/6~2015/6/5 (364日間) 貸付予定総額 2,443億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 66先
 成長基盤強化(本則第8回の借り換え) 6/6~2015/6/5 (364日間) 貸付予定総額 1,408億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 72先
 成長基盤強化(本則第4回の借り換え) 6/6~2015/6/5 (364日間) 貸付予定総額 3,449億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 86先
 成長基盤強化(ABL等特則第12期) 6/6~2018/6/5 (1,460日間) 貸付予定総額 313億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 13先
 成長基盤強化(ABL等特則第4期の借り換え) 6/6~2016/6/6 (731日間) 貸付予定総額 150億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 6先
 成長基盤強化(小口特則第9期) 6/6~2018/6/4 (1,459日間) 貸付予定総額 15.23億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 22先
 成長基盤強化(小口特則第5期の借り換え) 6/6~2015/6/5 (364日間) 貸付予定総額 5.53億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 15先
 成長基盤強化(小口特則第1期の借り換え) 6/6~2015/6/5 (364日間) 貸付予定総額 24.81億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 8先
 成長基盤強化(米ドル特則第8期) 6/6~2015/6/5 (364日間) 貸付予定総額 1,999百万ドル 貸付先数 25先
 成長基盤強化(米ドル特則第4期の借り換え) 6/6~2015/6/5 (364日間) 貸付予定総額 1,362百万ドル 貸付先数 26先

「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