

2015/4/8(水)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,200	100	▲ 1,000
財政		1,900	▲ 6,400	0
資金過不足		3,100	▲ 6,300	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
67,368				
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		4,900		
CP等買入				4,000
		▲ 100	▲ 400	
貸出支援基金				
(成長) 46,898				
(増加) 223,470				
被災地支援				
3,252				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入		300	200	
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		4,900	▲ 100	4,000
当預増減		8,000	▲ 6,400	3,000

当座預金残高	2,045,500	4/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,872,000		200
積み終了先	1,552,000	4/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,552,000	積数	200
非準備先残高	173,500	1日平均	0
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,984,900		
準備預金進捗率	99.99%	(実績)	77.42% (日数)

4/7のマネタリーベース	2,975,900
4/7コール 合計	197,335 無担 71,912 有担 125,423
コール前日増減 計	1,476 無担 ▲ 1,099 有担 2,575

4/8の加重平均レート(速報)				4/7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		
0.045 ~0.130 (0.059)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.045 ~0.130 (0.058)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.020 ~0.120 (0.059)					0.050 ~0.120 (0.061)			
0.080 ~0.090 (0.085)								
0.116 ~0.340 (0.193)					0.063 ~0.260 (0.112)			
0.118 (0.118)					0.340 (0.340)			
0.170 (0.170)		0.08-0.13	-	1M	0.080 ~0.185 (0.133)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M	0.145 (0.145)			
0.125 (0.125)		0.08-0.12	-	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完 4,000億円 4/8 ~ 4/9 (1日間) 応札 100億円 落札 100億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

<日銀金融政策決定会合・結果>

・マネタリーベースが、年間約80兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(賛成8反対1)
 ・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)
 長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。買入れの平均残存期間は7年~10年程度とする。
 ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約3兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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

《 4/9の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,039,100	前日比	▲ 6,400
O/N	0.05~0.06	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12
無担O/Nは0.05~0.06%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

《 8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6,000億円増加の155兆7,000億円(当座預金残高見込みは204兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.053~0.055%、大手行から0.05%程度での調達、出合いの中心レートは0.055%で始まった。一部業態からまとまった量を取り上げる場面も見られたものの、取り急ぐ動きはなく、一巡後は0.05~0.055%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関しては、証券業態によるロール案件中心の取引となった。日銀金融政策決定会合は現状維持が決定された。

《 8日のオープン市場動向 》

現先取引S/Nは下限域で推移した。短国市場は、金融政策決定会合は特段材料視されず、終日閑散な地合いであった。CP発行市場は10日発行にあたったことで、償還約900億円に対し発行総額は1,600億円程度に膨らんだ。概ね横ばいながら、まとまった金額の案件では若干ながらレートが上昇した。

《 9日の材料 》

- *日銀金融経済月報
- *MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
- *米国2月の卸売売上高
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、4/13発行)
- *30年利付国債入札(8,000億円、4/13発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、4/16借入)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.28-30
0.360 0.050	19,789.81 149.27	為替(5時)	119.85-87

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	4/1	4/2	4/3	4/6	4/7	4/8
日銀当預残	2,017,000	2,011,600	2,029,000	2,000,800	2,037,500	2,045,500
準備預金残	1,849,900	1,846,500	1,860,800	1,838,400	1,870,600	1,872,000
レート	0.056%	0.057%	0.058%	0.057%	0.058%	0.059%
月中平均	0.05600%	0.05650%	0.05740%	0.05733%	0.05743%	0.05763%