

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/4/17(金) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	17日需給速報		20日需給予想	21日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,700	▲ 100	▲ 1,000
財政		6,000	▲ 70,100	2,000
資金過不足		4,300	▲ 70,200	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,300	
67,408			▲ 800	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				27,500
国庫短期証売却				
国債買入		11,700		7,800
CP等買入				4,000
		▲ 400	▲ 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		800		
ETF買入			300	
国債補完供給				
小計		12,100	400	39,300
当預増減		16,400	▲ 69,800	40,300

当座預金残高	2,105,300	4/17以降の残り所要積立額	743,800
準備預金残高	1,925,000	4/20以降の残り所要積立額	63,900
積み終了先	1,563,900	積数	2,500
超過準備	1,367,300	1日平均	1,931,600
非準預先残高	180,300	積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	13.33% (日数)
準備預金進捗率	96.69% (実績)		

4/16のマネタリーベース		3,025,400	
4/16コール合計	205,630	無担	78,695
有担	126,935		
コール前日増減	計	7,622	無担
		9,335	有担
			▲ 1,713

4/17の加重平均レート(速報)				4/16の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.050 ~0.125 (0.063)	0.030 ~0.040 (0.031)	CP気配a-1	短国	O/N	0.045 ~0.130 (0.066)		
0.050 ~0.121 (0.076)				T/N		0.057 ~0.120 (0.070)	
				S/N			
0.059 ~0.200 (0.116)				1W	0.117 (0.117)	0.114 ~0.155 (0.117)	
				2W			
0.310 (0.310)				3W			
0.280 (0.280)		0.08-0.13	-	1M	0.170 (0.170)	0.118 (0.118)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.02-▲0.01	3M			
		-	-	6M			
		-	▲0.015	1Y			

## <<オペ情報、入札結果>>

国短買入	27,500億円	4/21 応札	33,801億円	落札	27,500億円	按分利回り較差	-0.035%	4.2%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	4,000億円	4/21 応札	8,134億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.018%	70.3%	平均利回り較差	-0.012%
国債買入	2,400億円	4/21 応札	5,120億円	落札	2,405億円	按分利回り較差	-0.010%	49.0%	平均利回り較差	-0.006%
国債買入	1,400億円	4/21 応札	3,512億円	落札	1,401億円	按分利回り較差	-0.029%	80.0%	平均利回り較差	-0.023%

J-REIT買入 12億円 約定日 4/17

<< 4/20の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,035,500	前日比	▲ 69,800
O/N	0.05~0.065	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。

## << 17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2兆1,000億円増額の159兆8,000億円(当座預金残高見込みは210兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06%、地銀・信託業態から0.06~0.063%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.06~0.065%の出合いが中心となった。一日を通して都銀の0.06%のビッドが下支えとなり、堅調な地合いで推移した。一巡後は、0.06%近辺の出合いが中心となった。ターム物は、1W物の期間で大手行による幅広い調達を確認された。

## << 17日のオープン市場動向 >>

現先S/N物は低位安定での推移となった。短国市場では短国買入オペが1兆円増額となる2兆7,500億円を実施され、平均利回較差▲0.003%・按分利回較差▲0.035%と按分が大幅に流れる結果となった。大方は市場実勢通りの応札だったとみられるが、札の集まりが若干悪い事を示す結果であった。オペ後のセカンダリ市場は、動意なく閑散な地合いが続いていた。CP市場は、償還総額1,100億円程度に対し発行総額は1,900億円程度となった。発行レートは、横ばい圏での動きであった。

## << 20日の材料 >>

\*2月の第3次産業活動指数

\*月例経済報告

## << コール3月積み期間分の加重平均レート >>

(土日を含む)	無担	0.06181%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06139%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	0.300	▲ 0.025	日経平均株価(終値)	19,652.88	▲ 232.89	為替(9時)	119.06-07
						為替(5時)	118.80-83

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	4/10	4/13	4/14	4/15	4/16	4/17
日銀当預残	2,040,100	2,021,100	2,052,300	2,115,700	2,088,900	2,105,300
準備預金残	1,861,800	1,845,200	1,874,600	1,933,800	1,909,100	1,925,000
レート	0.061%	0.060%	0.059%	0.061%	0.066%	0.063%
月中平均	0.05858%	0.05869%	0.05871%	0.05887%	0.05931%	0.05989%

「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