

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/4/28(火) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	28日需給速報		30日需給予想		1日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 4,100	▲ 3,100	▲ 2,000		
財政		▲ 400	▲ 5,000	▲ 7,000		
資金過不足		▲ 4,500	▲ 8,100	▲ 9,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
67,642						
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入		25,000				
国庫短期証売却						
国債買入		5,700	11,700			
CP等買入		▲ 200	▲ 4,500			
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470						
被災地支援						
3,251						
社債等買入		▲ 300	▲ 200			
ETF買入		300	100			
国債補充供給	即日	▲ 200	200			
小計		30,300	11,300	0		
当預増減		25,800	3,200	▲ 9,000		

当座預金残高	2,101,400	4/28以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,914,500		9,400
積み終了先	1,584,400	4/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,584,300	積数	7,300
非準預先残高	186,900	1日平均	500
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,932,100		
準備預金進捗率	99.62% (実績)	46.67% (日数)	

4/27のマネタリーベース		3,024,900	
4/27コール	合計	212,260	無担 87,698 有担 124,562
コール前日増減	計	1,359	無担 1,957 有担 ▲ 598

4/28の加重平均レート(速報)			4/27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	O/N	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.055 ~0.125 (0.064)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.125 (0.064)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.062 ~0.120 (0.065)				T/N		0.061 ~0.130 (0.077)	
				S/N			
0.080 ~0.130 (0.085)				1W		0.116 ~0.130 (0.128)	
0.310 (0.310)				2W			
				3W			
		0.08-0.13	-	1M		0.260 (0.260)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.01-▲0.001	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,000億円	4/28 ~ 4/30 (2日間)	応札	100億円	落札	100億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債補完	448億円	4/28 ~ 4/30 (2日間)	応札	40億円	落札	40億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
米ドル資金供給(固定金利方式)	4/30~5/14 (14日間) 応札なし 貸付利率 0.620%								
T-Bill3M	応札14兆7,872億円 落札4兆9,869億3,000万円(非競争入札:4,130億円) 5/7~8/3 ▲0.0020% 按分52.6643% 平均▲0.0058%								
2年利付国債(表面利率0.1%)	応札8兆9,227億円 落札2兆2,860億円(I非競争入札:2,131億円) 5/15~2017/5/15 0.002% 按分4.8281% 平均0.000%								
交付税特会	1兆500億円 5/13~11/12 応札3兆200億円 落札1兆500億円 0.086% 按分 5.3334% 平均 0.084%								

「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。」

<< 4/30の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,104,600	前日比	3,200
O/N	0.055~0.065	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.055~0.065%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 28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2兆8,000億円増加の159兆円(当座預金残高見込みは210兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.055~0.057%近辺、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0.063~0.064%の出合いが中心となった。一巡後は徐々に取り下がり0.055~0.064%の出合いに落ち着いた。ターム物は、証券業態のロール案件が中心となった。

<< 28日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばい圏で推移した。短国市場は3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.01~▲0.008%での出合いが見られるなか、落札結果は平均落札利回▲0.0058%・按分落札利回▲0.0020%と予想通りの結果となった。セカンダリー市場では▲0.003~▲0.001%での出合いが見られた。CP市場は、電機・石油・ノンバンク業態から大型の案件が見られ、入札ベースでの発行総額は2,500億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での取引となった。

- << 29日の材料 >>
 *米国FOMC(2日目) *米国1-3月期のGDP速報値
- << 30日の材料 >>
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(終了後、直ちに結果公表)
 *経済・物価情勢の展望(展望レポート)
 *黒田日銀総裁、定例会見
 *3月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲2.3%)
 *3月の住宅着工統計
 *米国3月の個人所得・消費支出 *米国4月のシカゴPM景況感指数
 *ユーロ圏4月の消費者物価指数速報値

JGB新発10年債	0.295	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	20,058.95	75.63	為替(9時)	119.13-15
						為替(5時)	119.02-04

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	4/21	4/22	4/23	4/24	4/27	4/28
日銀当預残	2,083,400	2,070,300	2,064,100	2,087,400	2,075,600	2,101,400
準備預金残	1,902,400	1,884,800	1,880,400	1,901,500	1,890,300	1,914,500
レート	0.062%	0.062%	0.063%	0.065%	0.064%	0.064%
月中平均	0.06010%	0.06018%	0.06030%	0.06085%	0.06096%	0.06117%

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