

2015/5/14(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	14日需給速報	15日需給予想	18日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	1,000	600	1,000
財政	▲ 38,700	14,100	▲ 10,000
資金過不足	▲ 37,700	14,700	▲ 9,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)			1,300
67,672			▲ 1,800
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			
	▲ 200	▲ 800	
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			
ETF買入	300	400	
国債補完供給	即日 700		
小計	800	4,500	▲ 500
当増減	▲ 36,900	19,200	▲ 9,500

当座預金残高	2,078,400	5/14以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,889,600		0
積み終了先	1,579,900	5/15以降の残り所要積立額	
超過準備	1,579,900	積数	0
非準預先残高	188,800	1日平均	0
積み期間(4/16～5/15)の所要準備額(積数)	1,951,300		
準備預金進捗率	100.00%	(実績)	96.67% (日数)

5/13のマネタリーベース				3,056,900		
5/13コール	合計	215,837	無担	86,976	有担	128,861
コール前日増減	計	7,640	無担	6,112	有担	1,528

5/14 の加重平均レート(速報)				5/13 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 ～0.075 (0.068)	0.030 ～0.040 (0.031)			0.045 ～0.075 (0.068)		0.030 ～0.040 (0.031)		
0.058 ～0.125 (0.075)				T/N	0.057 ～0.123 (0.071)			
				S/N	0.090 (0.090)			
0.116 ～0.130 (0.123)				1W	0.062 ～0.340 (0.096)			
				2W	0.310 (0.310)			
				3W				
		0.08-0.13	-	1M				有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.002-0.000	3M				
		-	▲0.015	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 5/18 ～ 8/17 (91日間) 応札 1,331億円 落札 1,331億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)

T-Bill3M 応札15兆6,501億2000万円 落札5兆73億4000万円(非競争入札:4,126億円) 5/18～8/17 0.0000% 按分27.1817% 平均▲0.0024%

30年利付国債(表面利率1.50%) 2兆4億円 応札7,297億円 5/18～2045/3/20 1.5260% 按分39.2971% 平均1.5140%

ETF買入 361億円 約定日 5/14

J-REIT買入 12億円 約定日 5/14

「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

<< 5/15の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,097,600	前日比	19,200
O/N	0.06～0.07	T/N	0.05～0.12	S/N	0.05～0.12
無担O/Nは0.06～0.07%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

<< 14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4兆6,000億円減少の157兆9,000億円(当座預金残高見込みは207兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託より0.058～0.06%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.065～0.068%の出合いと前日比横ばいで推移した。一巡後も概ね同水準での出合いであった。

<< 14日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは低位横ばいで推移した。短国市場は3M物の入札が実施された。W I 取引で▲0.002～▲0.001%のまとまった出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.0024%、按分落札利回0%、按分率27.1817%と概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーは▲0.001～0%で推移した。その他では、引け際に6M物が▲0.015%でまとまった出合いをつけた。CP市場は発行案件が少なく、発行総額は500億円程度にとどまった。発行レートは、若干低下したもののも見られたが、概ね横ばいだった。

<< 15日の材料 >>

*黒田日銀総裁、読売国際経済懇話会にて講演

*4月の企業物価指数

*4月の消費動向調査

*米国4月の鉱工業生産・設備稼働率

*米国5月のミシガン大消費者信頼感指数速報

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	119.19-20
0.445 ▲ 0.005	19,570.24 ▲ 194.48	為替(5時)	119.16-18

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	5/7	5/8	5/11	5/12	5/13	5/14
日銀当預残	2,047,700	2,083,900	2,090,300	2,080,200	2,115,300	2,078,400
準備預金残	1,861,700	1,896,200	1,903,700	1,895,300	1,926,600	1,889,600
レート	0.065%	0.068%	0.067%	0.067%	0.068%	0.068%
月中平均	0.06757%	0.06770%	0.06764%	0.06758%	0.06762%	0.06764%