

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/3(火)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想		5日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,200		1,000		0
財政		▲ 25,300		▲ 700		2,000
資金過不足		▲ 24,100		300		2,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
118,124						
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		9,100		2,600		
CP等買入						
		▲ 100		▲ 100		
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		▲ 200		▲ 100		
ETF買入						
国債補完供給						
小計		28,800		2,400		0
当預増減		4,700		2,700		2,000

当座預金残高	1,345,300	6/3以降の残り所要積立額	24,700
準備預金残高	1,226,900	6/4以降の残り所要積立額	積数
積み終了先	1,052,500	積数	21,100
超過準備	1,052,500	1日平均	1,800
非準備先残高	118,400	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	98.88% (実績)		61.29% (日数)

6/2のマネタリーベース		2,243,000	
6/2コール 合計	155,633	無担	58,933
有担		有担	96,700
コール前日増減	計	2,220	無担
有担		586	有担
			1,634

6/3の加重平均レート(速報)				6/2の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.035 ~0.075 (0.066)	0.040	~0.050 (0.041)		0.050 ~0.135 (0.067)			
0.065 ~0.120 (0.078)					0.065 ~0.120 (0.096)		
0.073 ~0.200 (0.106)					0.117 ~0.400 (0.173)		
0.117 ~0.330 (0.184)					0.118 ~0.180 (0.135)		
					0.140 (0.140)		
0.075 (0.075)		0.08-0.13	-	1M	0.150 (0.150)		有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.046-0.047	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

《オペ情報、入札結果》

国債補完 2,000億円 6/3 ~ 6/4 (1日間) 応札 5億円 落札 5億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 ミドル資金供給(固定金利方式) 6/5~6/12 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.590%
 10年利付国債(表面利率0.6%) 応札 8兆2,020億円 落札 2兆1,904億円(I 非競争入札:2,012億円) 6/20~2024/6/20 0.609% 按分31.5126% 平均

《 6/4の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,348,000	前日比	2,700
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心となろう。

《 4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は、前日比2,000億円増加の105兆3,000億円(当座預金残高見込は134兆6,000億円)。無担O/Nは0.064%の出合いで立ち上がり。大手行から0.06%程度、地銀、信託、証券業態を中心に0.06~0.065%前後の調達希望が始まった。税揚げの前倒しなどで需給上の不足日となったものの、昨日とほぼ同水準で推移し、一巡後は0.065~0.07%近辺での出合いがみられた。ターム物は、ロール案件による出合いが散見された。ミドル資金供給オペが1W物でオファーされ、応札は無かった。

《 4日のオープン市場動向 》
 現先レートS/Nは低下基調で推移。短国アウトライト市場は品薄感から堅調な展開。店頭見合いの買いで0.046~0.047%の出合いが見られた程度。CP市場は、月初のため引き続き発行件数が少なく、700億円程度の発行にとどまった。レートも動意に乏しく横ばい圏での推移となった。

《 5日の材料 》
 *米国ページブック
 *米国4月の貿易収支
 *米国5月のISM非製造業景況指数
 *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
 *ユーロ圏1-3月期のGDP改定値
 *交付税特別会計借入(10,500億円、6/12発行)

《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)	
0.585	0.005	15,034.25	98.33	102.44-45	102.34-35

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	5/27	5/28	5/29	5/30	6/2	6/3
日銀当預残	1,356,700	1,357,800	1,354,500	1,362,600	1,340,600	1,345,300
準備預金残	1,228,000	1,230,900	1,224,700	1,238,900	1,223,700	1,226,900
レート	0.066%	0.065%	0.070%	0.069%	0.067%	0.066%
月中平均	0.06726%	0.06718%	0.06728%	0.06739%	0.06800%	0.06733%

「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