

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/5(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

| | 5日需給速報 | | 6日需給予想 | | 9日当社予想 | |
|-------------|--------|-------|---------|----|--------|---------|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | 200 | ▲ 100 | | | 1,000 |
| 財政 | | 4,600 | 1,700 | | | ▲ 7,000 |
| 資金過不足 | | 4,800 | 1,600 | | | ▲ 6,000 |
| 貸出 | | | | | | |
| 売出手形 | | | | | | |
| 0 | | | | | | |
| 本店共通 | | | | | | |
| 0 | | | | | | |
| 全店共通 | | | | | | |
| 0 | | | | | | |
| 共通(固定) | | | | | | 1,400 |
| 118,124 | | | | | | ▲ 1,200 |
| 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 | | | 9,100 | | | |
| CP等買入 | | | | | | |
| | | ▲ 500 | ▲ 200 | | | |
| 貸出支援基金 | | | 12,000 | | | |
| (成長) 33,429 | | | | | | |
| (増加) 85,512 | | | ▲ 9,900 | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 3,782 | | | | | | |
| 社債等買入 | | | | | | |
| ETF買入 | | | | | | |
| 国債補完供給 | | | | | | |
| 小計 | | ▲ 500 | 11,000 | | | 200 |
| 当預増減 | | 4,300 | 12,600 | | | ▲ 5,800 |

| 当座預金残高 | 1,352,400 | 6/5以降の残り所要積立額 | |
|---------------------------|-------------|---------------|-----------|
| 準備預金残高 | 1,220,200 | | 17,300 |
| 積み終了先 | 1,050,200 | 6/6以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 1,049,200 | 積数 | 13,900 |
| 非準備先残高 | 132,200 | 1日平均 | 1,400 |
| 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 | 99.27% (実績) | 67.74% | (日数) |

| 6/4のマネタリーベース | | 2,248,300 | |
|--------------|---------|-----------|--------|
| 6/4コール 合計 | 154,757 | 無担 | 59,266 |
| 有担 | | 有担 | 95,491 |
| コール前日増減 | 計 | 483 | 無担 |
| 有担 | | 1,135 | 有担 |
| | | | ▲ 652 |

| 6/5の加重平均レート(速報) | | | 6/4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 |
| 0.050 ~0.135 (0.067) | 0.040 ~0.050 (0.041) | | | O/N 0.055 ~0.075 (0.066) | | 0.040 ~0.050 (0.041) |
| 0.067 ~0.120 (0.069) | | | | | 0.066 ~0.120 (0.090) | |
| | | | | | | |
| | | | | | 0.092 ~0.130 (0.100) | |
| 0.118 ~0.340 (0.155) | | | | | 0.118 (0.118) | |
| 0.118 (0.118) | | | | | | |
| | | 0.08-0.13 | - | | | |
| | | 0.08-0.13 | - | | | |
| | | 0.08-0.13 | 0.031-0.047 | | | |
| | | - | - | | | |
| | | - | - | | | |
| | | - | - | | | |

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 6/9 ~ 9/1 (84日間) 応札 1,440億円 落札 1,440億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 CP買入 4,500億円 6/10 応札 9,805億円 落札 4,287億円 按分レート 0.089% 47.4% 平均利回り較差 0.091%
 T-Bill3M 応札27兆643億円 落札5兆2,604億円(非競争入札:4,495億円) 6/9~9/8 0.0461% 按分 76.0283% 平均 0.0449%
 30年利付国債(表面利率1.7%) 応札1兆9,381億円 落札6,468億円(I非競争入札:523億円) 6/20~2044/6/20 1.717% 按分93.6250% 平均1.714%
 J-REIT買入 4億円 約定日 6/5

「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の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

| << 6/6の日銀調節とレート予想 >> | | | | | |
|----------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 1,365,000 | 前日比 | 12,600 |
| 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%前後での出会いが中心となろう。

<< 5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1,000億円減少の105兆7,000億円(当座預金残高見込は135兆2,000億円)。無担O/Nは0.065%の出会いで立ち上がり、大手行から0.06%、地銀・信託・証券業態から0.065%前後の調達希望で始まった。一巡後も0.065~0.068%を中心とした出会いで推移し、本日の取引を終了した。T/Nは0.065~0.07%前後の調達意欲がみられた。3M物の共通担保オペが8,000億円オファーされ、結果は落札総額1,440億円となり、札割れとなった。

<< 5日のオープン市場動向 >>
 現先レートは品薄感から低下基調で推移。短国アウトライイト市場は3M物の入札が実施された。足元が堅調な中、平均落札利回り0.0449%、按分落札利回り0.0461%の結果となった。セカンダリーではショートカバーから0.031%まで買い進まれた。CP発行市場は600億円程度と引き続き閑散。CP等買入オペは500億円増額の4,500億円オファーされたものの、按分レート0.089%、平均落札レート0.091%と前回比上昇の結果となった。

<< 6日の材料 >>
 *4月の景気動向指数速報
 *5月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *米国4月の消費者信用残高
 *米国5月の雇用統計
 *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、6/10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) | |
|-----------|-------|------------|-------|-----------|-----------|
| 0.615 | 0.005 | 15,079.37 | 11.41 | 102.55-57 | 102.63-65 |

| 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 | 5/29 | 5/30 | 6/2 | 6/3 | 6/4 | 6/5 |
| 日銀当預残 | 1,354,500 | 1,362,600 | 1,340,600 | 1,345,300 | 1,348,100 | 1,352,400 |
| 準備預金残 | 1,224,700 | 1,238,900 | 1,223,700 | 1,226,900 | 1,223,900 | 1,220,200 |
| レート | 0.070% | 0.069% | 0.067% | 0.066% | 0.066% | 0.067% |
| 月中平均 | 0.06728% | 0.06739% | 0.06800% | 0.06733% | 0.06700% | 0.06700% |