

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/6(金) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	6日需給速報		9日需給予想		10日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		100		1,500		1,000
財政		1,600		▲ 14,800		▲ 13,000
資金過不足		1,700		▲ 13,300		▲ 12,000
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				6,500
CP等買入						4,300
		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金		12,000				
(成長) 34,837						
(増加) 85,512		▲ 9,900				
被災地支援						
3,782						
社債等買入				▲ 100		
ETF買入						
国債補完供給						
小計		11,000		▲ 100		10,800
当預増減		12,700		▲ 13,400		▲ 1,200

当座預金残高	1,365,100	6/6以降の残り所要積立額	13,900
準備預金残高	1,237,900	6/9以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,067,400	積数	7,100
超過準備	1,067,400	1日平均	1,000
非準預先残高	127,200	積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	1,905,200
準備預金進捗率	99.63% (実績)		77.42% (日数)

6/5のマナタリーベース		2,252,400	
6/5コール 合計	154,865	無担	58,989
コール前日増減	計 108	無担	▲ 277
		有担	385

6/6の加重平均レート(速報)				6/5の加重平均レート(確報)							
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	
0.060	~0.135 (0.069)	0.040	~0.050 (0.041)			O/N	0.050	~0.135 (0.067)		0.040	~0.050 (0.041)
0.065	~0.125 (0.078)					T/N			0.067	~0.120 (0.069)	
						S/N					
0.117	(0.117)					1W					
						2W			0.118	~0.340 (0.155)	
						3W			0.118	(0.118)	
				0.08-0.13	-	1M					有担先日付分
				0.08-0.13	-	2M					
				0.08-0.13	0.0300	3M					
				-	0.033-0.035	6M					
				-	0.032-0.033	1Y					

## <<オペ情報、入札結果>>

国債買入	3,000億円	6/10	応札	12,674億円	落札	3,010億円	按分利回り較差	0.002%	4.8%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,000億円	6/10	応札	8,805億円	落札	2,002億円	按分利回り較差	0.002%	67.0%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	1,500億円	6/10	応札	3,603億円	落札	1,504億円	按分利回り較差	-0.014%	80.0%	平均利回り較差	-0.012%
T-Bill6M	応札18兆3,815億円		落札3兆2,315億円(非競争入札:2,684億2,000万円)		6/10~12/10		0.0359%	按分	83.3179%	平均	0.0339%

<< 6/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,351,700	前日比	▲ 13,400
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。

<< 6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6,000億円増加の106兆3,000億円(当座預金残高見込は136兆5,000億円)。無担O/Nは、大手行から0.065%、地銀・信託・証券業態を中心に0.067%前後の調達希望で立ち上がり、一部0.07%に取りあがる動きもみられた。一巡後も0.065~0.07%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。

<< 6日のオープン市場動向 >>  
 現先レートは横ばい圏の推移。短国市場は6M物の入札が実施された。WI取引で0.033%の出合いが見られていた中、平均落札利回り0.0339%、按分落札利回り0.0359%と落ち着いた結果であった。セカンダリーでは0.033~0.035%の出合いが見られた。CP市場は10日発行となったことで、発行総額は1,900億円に膨らんだ。発行レートは引き続き動意に乏しい。

<< 9日の材料 >>  
 \*1-3月期のGDP2次速報(市場予想:前期比年率+5.6%)  
 \*4月の国際収支 \*4月の特定サービス産業動態統計速報  
 \*5月の消費動向調査 \*5月の景気ウォッチャー調査

JGB新発10年債	0.600	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	15,077.24	▲ 2.13	為替(9時)	102.42-44
						為替(5時)	102.26-27

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	5/30	6/2	6/3	6/4	6/5	6/6
日銀当預残	1,362,600	1,340,600	1,345,300	1,348,100	1,352,400	1,365,100
準備預金残	1,238,900	1,223,700	1,226,900	1,223,900	1,220,200	1,237,900
レート	0.069%	0.067%	0.066%	0.066%	0.067%	0.069%
月中平均	0.06739%	0.06800%	0.06733%	0.06700%	0.06700%	0.06775%

「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