

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/9(月) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,100	800	0
財政		▲ 14,800	▲ 9,900	2,000
資金過不足		▲ 13,700	▲ 9,100	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,400		
118,379		▲ 1,200		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				15,000
国庫短期証売却				
国債買入			6,700	
CP等買入			4,300	
		▲ 200	▲ 700	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 85,512				
被災地支援				
3,782				
社債等買入		▲ 100	▲ 100	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 100	10,200	15,000
当預増減		▲ 13,800	1,100	17,000

当座預金残高	1,351,300	6/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,222,700		7,100
積み終了先	1,053,900	6/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,053,900	積数	5,800
非準預先残高	128,600	1日平均	1,000
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	99.70% (実績)		80.65% (日数)

6/6のマネタリーベース		2,265,000	
6/6コール合計	156,492	無担	59,645
		有担	96,847
コール前日増減	計	1,627	無担
		656	有担
			971

6/9の加重平均レート(速報)				6/6の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.030 ~0.135 (0.069)	0.040 ~0.050 (0.041)	CP気配a-1	短国	O/N	0.060 ~0.135 (0.069)	無担先日付分	有担当日分
0.065 (0.065)				T/N		0.065 ~0.125 (0.078)	
				S/N			
0.117 ~0.400 (0.176)				1W		0.117 (0.117)	
0.118 (0.118)				2W			
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.0320	3M			
		-	0.0360	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入 15,000億円 6/11 応札 35,710億円 落札 15,006億円 按分利回り較差 0.000% 71.3% 平均利回り較差 0.001%

「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

<< 6/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,352,400	前日比	1,100
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。					

<< 9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7,000億円減少の105兆6,000億円(当座預金残高見込は135兆2,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは地銀・信託・証券業態から0.065%前後の出合いで見られる中、大手行から0.06%前後の調達希望が始まった。一巡後は調達側が薄くなる中、0.065~0.068%の水準で出合いが散見され本日の取引を終了した。T/N物も0.065%での調達のみられた。

<< 9日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは小幅低下し、0.045~0.05%程度。短国アウトライイト市場は3M:0.032%、6M:0.036%の出合い。短国買入オペが1兆5,000億円通知され、按分利回り較差0.000%、平均利回り較差+0.001%、按分比率71.3%という結果になった。オペの通知額、落札結果ともに事前予想の範囲内で、オペ後も大きな動きは見られなかった。CP市場は、発行総額800億円程度と少なめ。目立ったイベントは無く、発行レートは横ばい圏で推移。

<< 10日の材料 >>

- *4月の第3次産業活動指数 *5月のマネーストック
- *米国4月の卸売売上高
- *流動性供給入札(3,000億円、6/12発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、6/18借入)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.62-64
0.595 ▲ 0.005	15,124.00 46.76	為替(5時)	102.45-46

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	6/2	6/3	6/4	6/5	6/6	6/9
日銀当預残	1,340,600	1,345,300	1,348,100	1,352,400	1,365,100	1,351,300
準備預金残	1,223,700	1,226,900	1,223,900	1,220,200	1,237,900	1,222,700
レート	0.067%	0.066%	0.066%	0.067%	0.069%	0.069%
月中平均	0.06800%	0.06733%	0.06700%	0.06700%	0.06775%	0.06789%