

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/10(火) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想		12日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		900		100		▲ 1,000
財政		▲ 9,800		400		▲ 1,000
資金過不足		▲ 8,900		500		▲ 2,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
118,379						
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				
		▲ 700		▲ 300		
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				
ETF買入						
国債補完供給		▲ 100		100		
小計		10,100		14,800		0
当預増減		1,200		15,300		▲ 2,000

<< 6/11の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,367,800	前日比	15,300
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。

<< 10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3,000億円減少の105兆3,000億円(当座預金残高見込は135兆2,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは大手行から0.06%、地銀・信託・証券業態から0.065%前後の出合いで始まった。一巡後以降も大手行含めて0.06~0.068%近辺での出合いが散見された。米ドル資金供給オペが1W物でオファーされ、200万ドルの落札となった。

<< 10日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは0.045~0.05%程度で前日からほぼ横ばい。短国アウトライト市場は3M:0.03%の出合い。需給的にタイトな状況が続いている中、売り物が少なく、出合い難い状況。CP市場は、発行総額1,000億円程度。ディーラーの応札姿勢がやや消極的な印象で、発行レートは横ばいから若干上昇した。

<< 11日の材料 >>

- *5月の企業物価指数
- *4-6月期の法人企業景気予測調査季報
- *米国5月の財政収支
- *国庫短期証券入札(2ヶ月、25,000億円、6/13発行)

当座預金残高	1,352,500	6/10以降の残り所要積立額	5,800
準備預金残高	1,219,400	6/11以降の残り所要積立額	4,300
積み終了先	1,050,400	積数	900
超過準備	1,050,400	1日平均	900
非準預先残高	133,100		
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	99.77% (実績)	83.87% (日数)	

JGB新発10年債	0.595	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	14,994.80	▲ 129.20	為替(9時)	102.48-50
						為替(5時)	102.24-25

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	6/3	6/4	6/5	6/6	6/9	6/10
日銀当預残	1,345,300	1,348,100	1,352,400	1,365,100	1,351,300	1,352,500
準備預金残	1,226,900	1,223,900	1,220,200	1,237,900	1,222,700	1,219,400
レート	0.066%	0.066%	0.067%	0.069%	0.069%	0.070%
月中平均	0.06733%	0.06700%	0.06700%	0.06775%	0.06789%	0.06810%

6/9のマナターベース				2,250,100		
6/9コール	合計	154,857	無担	58,886	有担	95,971
コール前日増減	計	▲ 1,635	無担	▲ 759	有担	▲ 876

6/10の加重平均レート(速報)				6/9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 (0.070)	0.040 ~0.050 (0.041)					O/N	0.030 ~0.135 (0.069)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.120 (0.072)						T/N		0.065 (0.065)	
						S/N			
0.073 ~0.200 (0.120)						1W		0.117 ~0.400 (0.176)	
						2W		0.118 (0.118)	
						3W			
				0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
				0.08-0.13	-	2M			
				0.08-0.13	0.0300	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 2,000億円 6/10 ~ 6/11 (1日間) 応札 46億円 落札 46億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 6/12~6/19 (7日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.590%

流動性供給 応札 8,159億円 落札 2,983億円 6/12 募入最大利回較差 0.004% 按分 66.7729% 募入平均利回較差 0.003%

交付税特会 1兆500億円 6/18~12/17 応札 2兆5,694億円 落札 1兆500億円 0.101% 按分50.5000% 平均 0.098%

「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す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