

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/11(水) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	11日需給速報		12日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	▲ 1,100	▲ 1,000
財政		400	▲ 400	45,000
資金過不足		500	▲ 1,500	44,000
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				6,000
CP等買入				
		▲ 300	▲ 200	
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		
小計		14,800	▲ 300	6,000
当預増減		15,300	▲ 1,800	50,000

当座預金残高	1,367,800	6/11以降の残り所要積立額	4,300
準備預金残高	1,235,200	6/12以降の残り所要積立額	3,200
積み終了先	1,068,400	積数	800
超過準備	1,068,400	1日平均	800
非準預先残高	132,600		
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	99.83% (実績)	87.10% (日数)	

6/10のマネタリーベース		2,250,400	
6/10コール	合計	152,869	無担 59,200 有担 93,669
コール前日増減	計	▲ 1,988	無担 314 有担 ▲ 2,302

6/11の加重平均レート(速報)			6/10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
0.045 ~0.135 (0.071)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.050 ~0.135 (0.070)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.120 (0.071)				T/N	0.065 ~0.120 (0.072)	
				S/N		
0.070 ~0.130 (0.085)				1W	0.073 ~0.200 (0.120)	
0.118 ~0.330 (0.153)				2W	0.140 (0.140)	
				3W		
		0.08-0.13	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.13	0.035-0.042	2M		
		0.08-0.13	-	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

## <<オペ情報、入札結果>>

社債買入	1,000億円	6/17 応札	2,220億円	落札	948億円	按分レート	0.115%	69.6%	平均落札レート	0.128%
国債買入	2,000億円	6/13 応札	7,628億円	落札	2,003億円	按分利回り較差	0.003%	64.2%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	6/13 応札	12,664億円	落札	4,010億円	按分利回り較差	0.006%	64.8%	平均利回り較差	0.006%

T-Bill2M 応札13兆1,140億円 落札2兆3,073億3,000万円(非競争入札:1,926億円) 6/13~8/4 0.0421% 按分8.4580% 平均0.0365%

<< 6/12の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,366,000	前日比	▲ 1,800
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。

### << 11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1兆8,000億円増加の107兆1,000億円(当座預金残高見込は136兆8,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは大手行から0.06%、地銀および信託業態から0.065%前後の調達希望で始まった。一巡後以降も0.065%近辺での出合いが散見された。また、一部業態から試し取りと思われる調達が0.125%で行われる中、本日の取引を終了した。

### << 11日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは0.065~0.07%程度で、発行日要因から若干上昇。短国アウトライト市場は2M物の入札が実施され、按分落札レート0.0421%、按分比率8.4580%、平均落札レート0.0365%の結果となった。WI取引では0.035%で買残り気配であったが、入札結果は流れた印象。セカンダリーでも0.04~0.042%の出合いと小甘い展開となった。CP市場は、15日分の前倒し発行から、発行総額2,000億円程度とやや多め。発行レートは、a-1格の一般事業法人銘柄を中心に若干上昇基調。

### << 12日の材料 >>

- \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、13日まで)
- \*4月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲11.9%)
- \*4月のマネタリーサーベイ
- \*米国4月の企業在庫 \*米国5月の小売売上高
- \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、6/16発行)
- \*5年利付国債入札(27,000億円、6/20発行)

JGB新発10年債	0.600	0.005	日経平均株価(終値)	15,069.48	74.68	為替(9時)	102.30-32
						為替(5時)	102.27-29

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	6/4	6/5	6/6	6/9	6/10	6/11
日銀当預残	1,348,100	1,352,400	1,365,100	1,351,300	1,352,500	1,367,800
準備預金残	1,223,900	1,220,200	1,237,900	1,222,700	1,219,400	1,235,200
レート	0.066%	0.067%	0.069%	0.069%	0.070%	0.071%
月中平均	0.06700%	0.06700%	0.06775%	0.06789%	0.06810%	0.06836%

「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