

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/12(木) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	12日需給速報		13日需給予想		16日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300		▲ 800		0
財政		▲ 200		43,600		▲ 21,000
資金過不足		▲ 1,500		42,800		▲ 21,000
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						▲ 1,700
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				6,100		
CP等買入						
		▲ 200		▲ 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		▲ 100		
ETF買入						
国債補完供給						
小計		▲ 300		5,700		▲ 300
当預増減		▲ 1,800		48,500		▲ 21,300
当座預金残高	1,366,000	6/12以降の残り所要積立額				
準備預金残高	1,236,600	3,200				
積み終了先	1,068,300	6/13以降の残り所要積立額				
超過準備	1,068,300	積数				
非準備先残高	129,400	1日平均				
		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	99.90%	(実績)				90.32%
		(日数)				

<< 6/13の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,414,500	前日比	48,500
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。

<< 12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2,000億円増加の107兆3,000億円(当座預金残高見込は136兆6,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06%、地銀・信託業態を中心に0.065%の調達希望で始まった。一巡後も0.065%近辺での出合いが散見され、本日の取引を終了した。ターム物は、大手行から1M物0.118%で調達が見られた。共通担保オペは3M物が8,000億円でオファーされ、落札総額1,430億円で札割れとなった。

<< 12日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは0.085%程度で、前日に続いて発行日要因から上昇した。短国アウトライト市場は2M:0.038%、3M:0.035~0.039%、6M:0.034%の出合い。3M物の入札が実施され、按分落札レート0.0396%、按分比率39.5526%、平均落札レート0.0372%となった。W I取引では0.038~0.039%の出合いで、入札結果も無難な印象だったものの、セカンダリーでは若干買いが強まった。CP市場は発行総額1,700億円程度。このところレートは上昇基調となっていたが、一部ディーラーがやや積極的な応札姿勢を見せ、発行レートは前日から横ばい。

<< 13日の材料 >>  
 \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)  
 \*黒田日銀総裁、定例会見  
 \*4月の石油等消費動態統計  
 \*米国5月の生産者物価指数 \*米国6月のミシガン大消費者信頼感指数速報

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.99-01
0.595 ▲ 0.005	14,973.53 ▲ 95.95	為替(5時)	102.07-08

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	6/5	6/6	6/9	6/10	6/11	6/12
日銀当預残	1,352,400	1,365,100	1,351,300	1,352,500	1,367,800	1,366,000
準備預金残	1,220,200	1,237,900	1,222,700	1,219,400	1,235,200	1,236,600
レート	0.067%	0.069%	0.069%	0.070%	0.071%	0.071%
月中平均	0.06700%	0.06775%	0.06789%	0.06810%	0.06836%	0.06858%

6/11のマネタリーベース				2,265,600		
6/11コール	合計	152,073	無担	57,823	有担	94,250
コール前日増減	計	▲ 796	無担	▲ 1,377	有担	581

6/12の加重平均レート(速報)				6/11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		有担当日分	
0.050 ~0.125 (0.071)	0.040 ~0.050 (0.041)					O/N	0.045 ~0.135 (0.071)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.070 ~0.120 (0.084)						T/N			
						S/N	0.065 ~0.120 (0.071)		
0.117 (0.117)						1W	0.070 (0.070)	0.130 (0.130)	
0.118 (0.118)						2W		0.118 ~0.330 (0.153)	
						3W			
0.118 ~0.350 (0.128)				0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
				0.08-0.13	0.0380	2M			
				0.08-0.13	0.035-0.039	3M			
				-	0.0340	6M			
				-	-	1Y			

## <<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 6/16 ~ 9/8 (84日間) 応札 1,430億円 落札 1,430億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 T-Bill3M 応札25兆7,295億円 落札5兆2,021億4,000万円(非競争入札:4,578億円) 6/16~9/16 0.0396% 按分39.5526% 平均0.0372%  
 5年利付国債(表面利率0.2%) 応札10兆9,600億円 落札2兆4,534億円(I非競争入札:2,426億円) 6/20~2019/6/20 0.183% 按分38.5305% 平均0.183%

「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