

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/13(金) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	13日需給速報		16日需給予想	17日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	900	0
財政		43,700	▲ 24,400	1,000
資金過不足		42,800	▲ 23,500	1,000
貸出				
売出手形				
本店共通				
全店共通				
共通(固定)			1,400	
118,379			▲ 1,700	
国債買現				
CP買現				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入		6,100		
CP等買入		▲ 300	▲ 400	
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		900
ETF買入				
国債補完供給				
小計		5,700	▲ 700	900
当預増減		48,500	▲ 24,200	1,900
当座預金残高 1,414,500				
6/13以降の残り所要積立額				
準備預金残高 1,287,200				
1,900				
6/16以降の残り所要積立額				
積み終了先 1,104,700				
積数 1,841,700				
超過準備 1,104,100				
1日平均 61,400				
非準備先残高 127,300				
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数) 1,905,200				
6月の新所要見込 61,400 (一日平均)				

6/12のマナターベース		2,265,000	
6/12コール	合計	151,500	無担 57,217 有担 94,283
コール前日増減	計	▲ 573	無担 ▲ 606 有担 33

6/13の加重平均レート(速報)				6/12の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.055 ~0.090 (0.069)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.050 ~0.125 (0.071)		0.070 ~0.120 (0.084)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.125 (0.082)								
0.118 (0.118)						0.117 (0.117)		
						0.118 (0.118)		
0.118 ~0.121 (0.120)		0.08-0.13	-			0.118 ~0.350 (0.120)		有担先日付分
		0.08-0.13	0.0370					
		0.08-0.13	-					
		-	-					
		-	-					
		-	-					

<<オペ情報、入札結果>>

ETF買入 130億円 約定日 6/13

<<日銀金融政策決定会合・結果>>

- ・マナターベースが、年間約60~70兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(全員一致)
- ・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。
 - ①長期国債について、保有残高が年間約50兆円に相当するペースで増加し、平均残存期間が7年程度となるよう買入れを行う。
 - ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約1兆円、年間約300億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 - ③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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

<< 6/16の日銀調節とレート予想 >>

日銀調節	見送り	当座預金残高	1,390,300	前日比	▲ 24,200
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。

<< 13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3兆円増加の110兆3,000億円(当座預金残高見込は141兆5,000億円)。無担O/N大手行から0.065%、地銀・信託・証券業態から0.066~0.07%近辺の調達希望で始まった。積みの実質的な最終日であるが、年金の定時払いもあつてか取り上がる動きはみられず。一巡後も同水準での出合いが散見される中で、本日の取引を終了した。ターム物は、大手行から2W、1M物で0.118%の調達が見られた。日銀金融政策決定会合が開催され、現状維持が発表された。

<< 13日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは0.08%程度で、前日から若干低下。短国アウトライト市場は2M:0.037%の出合い。月曜日に短国買入オペの通知が予想される中、売り物が出難く、3Mは0.03%近辺の気配。CP市場は発行総額400億円程度と少なめ。目立ったイベントは無く、閑散。

<< 16日の材料 >>

- *日銀金融経済月報
- *米国5月の鉱工業生産・設備稼働率
- *ユーロ圏5月の消費者物価指数改定値

<<コール5月積み期間分の加重平均レート>>

(土日を含む)	無担	0.06877%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06895%	有担	0.04100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.600	0.595	15,097.84	124.31	101.72-73	101.82-83

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	6/6	6/9	6/10	6/11	6/12	6/13
日銀当預残	1,365,100	1,351,300	1,352,500	1,367,800	1,366,000	1,414,500
準備預金残	1,237,900	1,222,700	1,219,400	1,235,200	1,236,600	1,287,200
レート	0.069%	0.069%	0.070%	0.071%	0.071%	0.069%
月中平均	0.06775%	0.06789%	0.06810%	0.06836%	0.06858%	0.06867%