

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/18(水) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	18日需給速報		19日需給予想		20日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 1,300	▲ 2,000		
財政		900	0	52,000		
資金過不足		500	▲ 1,300	50,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
118,159						
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入		10,000				
国庫短期証売却						
国債買入				11,900		
CP等買入		▲ 200	▲ 4,000	▲ 100		
貸出支援基金(成長)					49,900	
34,837(増加)					▲ 1,900	
85,512						
被災地支援						
3,782						
社債等買入		▲ 100				
ETF買入						
国債補完供給						
小計		9,700	3,900	59,900		
当預増減		10,200	2,600	109,900		

当座預金残高	1,404,400	6/18以降の残り所要積立額	457,000
準備預金残高	1,264,900	6/19以降の残り所要積立額	240,700
積み終了先	1,015,000	積数	240,700
超過準備	861,800	1日平均	8,900
非準預先残高	139,500	積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,841,700
準備預金進捗率	86.93% (実績)		10.00% (日数)

6/17のマネタリーベース		2,293,300	
6/17コール合計	159,919	無担	64,721
		有担	95,198
コール前日増減	計	2,654	無担
		2,830	有担
			▲ 176

6/18の加重平均レート(速報)				6/17の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.050 ~0.125 (0.068)	0.040 ~0.050 (0.041)	CP気配a-1	短国	O/N	0.050 ~0.125 (0.066)		有担当日分
0.066 ~0.125 (0.090)				T/N		0.060 ~0.120 (0.069)	
				S/N			
0.280 (0.280)				1W		0.073 ~0.200 (0.120)	
0.135 (0.135)				2W		0.180 ~0.330 (0.244)	
0.148 (0.148)				3W			
				1M			
		0.08-0.13	-	2M			有担先日付分
		0.08-0.13	-	3M			
		0.08-0.13	-	6M			
		-	0.0330	1Y			
		-	0.035-0.0388				

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	1,500億円	6/20 応札	4,020億円	落札	1,506億円	按分利回り較差	0.007%	58.1%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	1,400億円	6/20 応札	5,890億円	落札	1,410億円	按分利回り較差	-0.2%	15.7%	平均利回り較差	-0.319%
貸出増加支援	6/20~2015/6/19 (364日間)	貸付予定総額	201億円	貸付利率	0.10%					
貸出増加支援	6/20~2016/6/20 (731日間)	貸付予定総額	0億円	貸付利率	0.10%					
貸出増加支援	6/20~2017/6/20 (1,096日間)	貸付予定総額	321億円	貸付利率	0.10%					
貸出増加支援	6/20~2018/6/20 (1,461日間)	貸付予定総額	49,368億円	貸付利率	0.10%					
T-Bill1Y	応札13兆897億円	落札2兆3,215億1,000万円(非競争入札)	1,784億1,000万円	6/20~2015/6/22	0.0388%	按分	9.8833%	平均	0.0368%	
交付税特会	1兆500億円	6/26~12/25 応札	2兆9,074億円	落札	1兆500億100万円	0.097%	按分	48.4020%	平均	0.095%

「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。」

<< 6/19の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,407,000	前日比	2,600
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心となろう。

<< 18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みは、前日比7,000億円増加の108兆3,000億円(当預金残高見込みは140兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06~0.063%、地銀・信託業態から0.064~0.065%、証券業態から0.065~0.066%の調達希望。立ち上がりは0.065~0.067%を中心とした出合い。一巡後は全体的に取り下がったものの、0.06%のメガバンクのビッドが下支えとなり底堅く推移した。ターム物は、動意に乏しい展開となった。

<< 18日のオープン市場動向 >>

現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は1Y物の入札が実施され、平均落札利回り0.0368%、最高落札利回り0.0388%と事前予想通りながらも強めの結果となった。セカンダリーでは0.035%の出合いが見られた程度。CP市場は20日発行となり石油、鉄鋼業態からまとまった発行も見られ総額3,000億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいながらも、一部銘柄では積極的な応募が見られたことで若干レートが低下した。

<< 19日の材料 >>

- *4月の景気動向指数改訂状況
- *森本日銀審議委員、秋田県金融経済懇談会にて講演
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、6/23発行)

<< 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	0.595	0.005	日経平均株価(終値)	15,115.80	139.83	為替(9時)	102.17-19
						為替(5時)	102.22-24

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	6/11	6/12	6/13	6/16	6/17	6/18
日銀当預残	1,367,800	1,366,000	1,414,500	1,389,300	1,394,200	1,404,400
準備預金残	1,235,200	1,236,600	1,287,200	1,258,600	1,257,300	1,264,900
レート	0.071%	0.071%	0.069%	0.067%	0.066%	0.068%
月中平均	0.06836%	0.06858%	0.06867%	0.06856%	0.06841%	0.06839%

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