

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/24(火) <セントラル短資株式会社>

<<資金需給>>

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想	26日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,600	▲ 1,500	▲ 2,000
財政		2,700	2,900	▲ 3,000
資金過不足		1,100	1,400	▲ 5,000
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		20,000		
国庫短期証売却				
国債買入			5,300	
CP等買入				
		▲ 200	▲ 1,100	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488				
被災地支援				
3,782				
社債等買入		▲ 100	▲ 100	
ETF買入				
国債補完供給		100		
小計		19,800	4,100	0
当預増減		20,900	5,500	▲ 5,000

当座預金残高	1,528,700	6/24以降の残り所要積立額	80,300
準備預金残高	1,387,500	6/25以降の残り所要積立額	63,400
積み終了先	1,143,300	積数	3,000
超過準備	1,142,900	1日平均	3,000
非準預先残高	141,200	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	96.56% (実績)		30.00% (日数)

6/23のマネタリーベース		2,410,700	
6/23コール	合計	162,130	無担 64,420 有担 97,710
コール前日増減	計	▲ 469	無担 ▲ 1,530 有担 1,061

6/24の加重平均レート(速報)			6/23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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.055 ~0.135 (0.066)	0.040 ~0.050 (0.041)		0.050 ~0.135 (0.065)			
0.060 ~0.066 (0.065)				0.064 ~0.125 (0.070)		
					0.180 ~0.400 (0.224)	
0.073 ~0.230 (0.087)				0.118 (0.118)		
					0.118 (0.118)	有担先日付分
		0.08-0.13	-			
		0.08-0.13	-			
		0.08-0.13	0.0240			
		-	-			
		-	-			
		-	-			

<< 6/25の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,534,200	前日比	5,500
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。					

<< 24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2兆6,000億円増加の115兆7,000億円(当金残高見込みは152兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06%近辺、信託・証券業態から0.063%近辺の調達希望。立ち上がりは0.064%を中心とした出合い。調達意欲は弱く、一巡後は0.06%近辺での出合いを中心に推移した。ターム物はロール案件の取引が中心となった。

<< 24日のオープン市場動向 >>
短国市場は、玉不足から現先レートは低位安定。セカンダリーでも出合いはほとんど無く、閑散なマーケットとなった。CP市場は、償還総額900億円程度に対し、大型発行案件もみられたことから発行総額は1,300億円強に膨らんだ。発行レートは、ディーラー・投資家の購入ニーズが強く、横ばい圏から小幅低下での動きとなった。

<< 25日の材料 >>
*5月の企業向けサービス価格指数
*米国1-3月期のGDP確報値
*米国5月の耐久財新規受注

JGB新発10年債	0.580	0.000	日経平均株価(終値)	15,376.24	6.96	為替(9時)	101.87-89
						為替(5時)	101.96-98

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	6/17	6/18	6/19	6/20	6/23	6/24
日銀当預残	1,394,200	1,404,400	1,406,800	1,513,900	1,507,800	1,528,700
準備預金残	1,257,300	1,264,900	1,265,000	1,365,600	1,363,600	1,387,500
レート	0.066%	0.068%	0.066%	0.066%	0.065%	0.066%
月中平均	0.06841%	0.06839%	0.06826%	0.06795%	0.06783%	0.06775%

<<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 6/26~7/3 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.600%
流動性供給 応札 1兆4,071億円 落札 3,995 億円 6/26 募入最大利回較差 ▲0.013% 按分 55.4588% 募入平均利回較差 ▲0.014%
ETF買入 130億円 約定日 6/24

「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