

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/25(水) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	25日需給速報		26日需給予想		27日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,600	▲ 2,400	▲ 2,000		
財政		3,700	▲ 3,700	2,000		
資金過不足		2,100	▲ 6,100	0		
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						
国庫短期証売却						
国債買入		5,300		9,000		
CP等買入		▲ 1,100	▲ 200			
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488						
被災地支援					500	
3,782					▲ 500	
社債等買入		▲ 100				
ETF買入						
国債補完供給						
小計		4,100	▲ 200	9,000		
当預増減		6,200	▲ 6,300	9,000		

当座預金残高	1,534,900	6/25以降の残り所要積立額	63,400
準備預金残高	1,390,900		
積み終了先	1,149,600	6/26以降の残り所要積立額	48,300
超過準備	1,148,600	積数	2,400
非準預先残高	144,000	1日平均	2,400
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	97.38% (実績)	33.33% (日数)	

6/24のマネタリーベース		2,433,200	
6/24コール	合計	167,213	無担 67,543 有担 99,670
コール前日増減	計	5,083	無担 3,123 有担 1,960

6/25の加重平均レート(速報)			6/24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
0.030 ~0.135 (0.069)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.055 ~0.135 (0.066)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.063 ~0.066 (0.065)					0.060 ~0.066 (0.065)	
0.075 (0.075)					0.073 ~0.230 (0.087)	
0.116 (0.116)						
		0.08-0.12	-			有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	0.0220			
		-	0.0250			
		-	-			

<<オペ情報、入札結果>>

CP買入	4,500億円	6/30	応札	9,125億円	落札	4,291億円	按分レート	0.077%	2.9%	平均落札レート	0.083%
国債買入	3,000億円	6/27	応札	13,067億円	落札	3,005億円	按分利回り較差	0.003%	58.6%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,000億円	6/27	応札	8,655億円	落札	2,003億円	按分利回り較差	0.003%	84.4%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	4,000億円	6/27	応札	13,997億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.003%	41.6%	平均利回り較差	-0.003%
預保借入(金融再生動定)	548億円	7/4~2015/6/12	応札	2,688億円	落札	548億円	0.097%	按分	42.701%	平均	0.088%

<< 6/26の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,528,600	前日比	▲ 6,300
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。

<< 25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9,000億円増加の116兆6,000億円(当座預金残高見込みは153兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.055~0.06%近辺、信託・証券業態から0.065%近辺の調達希望。立ち上がりは0.061~0.065%を中心とした出合い。調達意欲は弱く、一巡後は0.06%近辺までレートが低下したものの、まとまったオファーが入った際には積極的にテイクンされる場面も見られた。ターム物は閑散であった。

<< 25日のオープン市場動向 >>
 短国市場は、引き続き現先レートが低位安定で推移。セカンダリーは、3M物0.022%で少額の出合いが観測される程度の閑散状態。現状のレート水準では、店頭購入ニーズも限定的であった。CP市場では、食料品・機械業態より大型発行案件がみられたことで、発行総額は4,300億円程度(償還総額2,300億円程度)に膨らんだ。発行市場では、最上位格付け銘柄のレート低下が多くみられた。

<< 26日の材料 >>
 *米国5月の個人所得・消費支出
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、6/30発行)
 *2年利付国債入札(27,000億円、7/15発行)

JGB新発10年債	0.575	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	15,266.61	▲ 109.63	為替(9時)	101.91-93
						為替(5時)	101.90-91

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	6/18	6/19	6/20	6/23	6/24	6/25
日銀当預残	1,404,400	1,406,800	1,513,900	1,507,800	1,528,700	1,534,900
準備預金残	1,264,900	1,265,000	1,365,600	1,363,600	1,387,500	1,390,900
レート	0.068%	0.066%	0.066%	0.065%	0.066%	0.069%
月中平均	0.06839%	0.06826%	0.06795%	0.06783%	0.06775%	0.06780%

「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