

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/6/26(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	26日需給速報 即日 金額	27日需給予想 金額	30日当社予想 金額
銀行券	▲ 2,700	▲ 2,500	▲ 1,200
財政	▲ 3,500	5,300	▲ 13,500
資金過不足	▲ 6,200	2,800	▲ 14,700
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)			1,600
118,159			▲ 1,000
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		9,100	
CP等買入			4,300
	▲ 200	▲ 900	
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			
ETF買入			
国債補完供給			
小計	▲ 200	8,200	4,900
当預増減	▲ 6,400	11,000	▲ 9,800

当座預金残高	1,528,500	6/26以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,389,400		48,300
積み終了先	1,152,100	6/27以降の残り所要積立額	
超過準備	1,151,100	積数	38,700
非準備先残高	139,100	1日平均	2,000
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	97.90%	(実績)	36.67% (日数)

6/25のマネタリーベース	2,441,000
6/25コール 合計	167,071 無担 70,240 有担 96,831
コール前日増減 計	▲ 142 無担 2,697 有担 ▲ 2,839

6/26 の加重平均レート(速報)				6/25 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	
0.050 ~0.135 (0.066)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N	0.030 ~0.135 (0.069)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.063 ~0.120 (0.072)				T/N		0.063 ~0.066 (0.065)		
				S/N				
				1W		0.075 (0.075)		
0.116 (0.116)				2W				
				3W		0.116 (0.116)		
0.090 ~0.118 (0.117)		0.08-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.021-0.026	3M				
		-	0.0250	6M				
		-	0.0250	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 6/30 ~ 9/22 (84日間) 応札 1,590億円 落札 1,590億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
T-Bill3M 応札26兆5,846億円 落札5兆2,362億9,000万円(非競争入札:4,536億5,000万円) 6/30~9/29 0.0260% 按分37.2161% 平均0.0244%
2年利付国債(表面利率0.1%) 応札12兆92億円 落札2兆4,874億円(I 非競争入札:2,101億円) 7/15~2016/7/15 0.084% 按分67.6465% 平均0.084%
J-REIT買入 4億円 約定日 6/26

「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

<< 6/27の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,539,500	前日比	11,000
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。

<< 26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6,000億円減少の116兆円(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0.055~0.06%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0.06~0.065%近辺を中心とした出合い。調達意欲は弱く、一巡後は0.06%近辺の出合いが中心となる軟調な展開であったが、まとまったオファーが入った際には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。

<< 26日のオープン市場動向 >>
短国現先は低位安定。短国市場では3M物入札が実施された。W I 取引において0.024~0.026%で取引が見られる中、落札結果は平均落札利回り0.0244%、最高落札利回り0.026%と、事前予想通りながらも強めの結果となった。セカンドリーは0.021%まで買い進まれたものの、このレベルでの購入ニーズは限定的なこともあり、ラストは0.0244%がオファーとなった。CP市場では、償還総額1兆9,300億円程度に対し発行総額は5,500億円程度にとどまり、大幅な償還超となった。発行レートは、投資家の購入ニーズが強かったものの、概ね横ばい圏の動きとなった。

<< 27日の材料 >>
*5月の完全失業率(市場予想:3.6%)
*5月の有効求人倍率(市場予想:1.08倍)
*5月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲2.0%)
*5月全国・6月都区部消費者物価指数(CPI)
市場予想:全 国(5月)前年同月比(除く生鮮):+3.4%
東京都区部(6月)前年同月比(除く生鮮):+2.8%
*5月の商業販売統計速報

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.82-83
0.565 ▲ 0.010	15,308.49 41.88	為替(5時)	101.78-80

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	6/19	6/20	6/23	6/24	6/25	6/26
日銀当預残	1,406,800	1,513,900	1,507,800	1,528,700	1,534,900	1,528,500
準備預金残	1,265,000	1,365,600	1,363,600	1,387,500	1,390,900	1,389,400
レート	0.066%	0.066%	0.065%	0.066%	0.069%	0.066%
月中平均	0.06826%	0.06795%	0.06783%	0.06775%	0.06780%	0.06773%