

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/6/4(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想		8日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		300	0	1,000		
財政		3,600	2,100	2,000		
資金過不足		3,900	2,100	3,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)				700		
68,307				▲ 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			11,800			
CP等買入		▲ 100	▲ 600			
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470			9,000			
被災地支援			▲ 8,600			
3,244						
社債等買入			▲ 100			
ETF買入		200				
国債補完供給						
小計		100	11,500	▲ 300		
当増減		4,000	13,600	2,700		
当座預金残高	2,094,500	6/4以降の残り所要積立額				
準備預金残高	1,909,500	7,600				
積み終了先	1,604,800	6/5以降の残り所要積立額				
超過準備	1,604,700	積数				
非準備先残高	185,000	1日平均				
		500				
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	2,012,300					
準備預金進捗率	99.71%	(実績)	64.52%	(日数)		

<< 6/5の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,108,100	前日比	13,600
O/N	0.06~0.075	T/N	0.055~0.12	S/N	0.055~0.12
無担O/Nは0.07%台半ばでの出合いが中心になると予想される。					

<< 4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、161兆2,000億円(当座預金残高見込みは209兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.073%、大手行からは0.068%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.073~0.075%と昨日と同様、こじっかりとした立ち上がりとなった。一巡後はビッドが薄くなり、0.07%前後での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<< 4日のオープン市場動向 >>
 現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は3M物の入札が実施された。落札結果は、平均落札利回0.0012% 按分落札利回0.0020%となり、一部でみられていた事前予想よりも堅調な結果となった。セカンダリーでは、3Mで0~0.0020%のレンジで出合いが見られた。CP発行市場は、500億円程度の償還に対して、650億円程度の発行となり、規模はさほど膨らまなかった。CP発行レートは月内償還物を中心にやや高めめの決着となった。また、CP等買入オペアが3,500億円でオファーされ、平均落札利回0.091%、按分落札利回0.085%という結果になった。

<< 5日の材料 >>
 *4月の景気動向指数速報
 *5月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *米国4月の消費者信用残高 *米国5月の雇用統計
 *ユーロ圏1-3月期のGDP改定値

<<コール5月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06945%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06928%	有担 0.03100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)		124.30-32	
0.500	0.035	20,488.19	14.68	為替(5時)		124.28-30	

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	5/28	5/29	6/1	6/2	6/3	6/4
日銀当預残	2,119,800	2,130,200	2,111,900	2,091,000	2,090,500	2,094,500
準備預金残	1,927,500	1,944,600	1,931,900	1,915,600	1,912,700	1,909,500
レート	0.071%	0.073%	0.073%	0.075%	0.074%	0.073%
月中平均	0.06907%	0.06945%	0.07300%	0.07400%	0.07400%	0.07375%

6/3のマネタリーベース				3,031,100	
6/3コール	合計	194,633	無担	67,571	有担 127,062
コール前日増減	計	▲ 6,249	無担	▲ 2,726	有担 ▲ 3,523

6/4の加重平均レート(速報)				6/3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	
0.055 ~0.125 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)				O/N 0.055 ~0.080 (0.074)		0.065 ~0.120 (0.078)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.067 ~0.120 (0.084)						T/N					
						S/N					
0.091 ~0.117 (0.101)						1W		0.064 ~0.130 (0.095)			
						2W		0.118 (0.118)			
						3W					
				0.08-0.13	-	1M				有担先日付分	
				0.08-0.12	-	2M					
0.120 (0.120)				0.08-0.12	0-0.002	3M					
				-	-	6M					
				-	-	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>
 全店共通 8,000億円 6/8 ~ 9/7 (91日間) 応札 700億円 落札 700億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 国債補完 8,000億円 6/4 ~ 6/5 (1日間) 応札 21億円 落札 21億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 CP買入 3,500億円 6/9 応札 9,537億円 落札 3,498億円 按分レート 0.085% 41.4% 平均落札レート 0.091%

T-Bill3M 応札18兆89億8,000万円 落札4兆9,804億3,000万円(非競争入札:4,495億円) 6/8~9/7 0.0020% 按分94.5434% 平均0.0012%
 30年利付国債(表面利率1.6%) 応札2兆2,388億円 落札7,299億円(I非競争入札:695億円) 6/22~2045/6/20 1.534% 按分10.2896% 平均1.527%
 J-REIT買入 13億円 約定日 6/4

「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す書面や目録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