

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/6/5(金) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	5日需給速報		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	1,300	1,000
財政		1,400	▲ 1,200	1,000
資金過不足		1,500	100	2,000
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				5,000
国庫短期証売却				
国債買入		11,800		11,600
CP等買入				3,500
		▲ 600	▲ 200	
貸出支援基金		9,000		
(成長) 48,511				
(増加) 223,470		▲ 8,600		
被災地支援				
3,244				
社債等買入		▲ 100	▲ 100	
ETF買入			200	
国債補完供給				
小計		11,500	▲ 400	20,100
当預増減		13,000	▲ 300	22,100

6/8の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,107,200	前日比	▲ 300
O/N	0.06~0.075	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.07%台前半での出合いが中心になると予想される。

<< 5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、161兆9,000億円(当座預金残高見込みは210兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.075%、大手行からは0.07~0.073%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.075~0.076%とやや強めの立ち上がりとなった。一巡後は徐々にビッドが薄くなり、0.07%近辺での出合いが散見されつつ、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<< 5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、短国買入オペが5,000億円オファーされ、平均利回較差±0.000%、按分利回較差0.001%の落ち着いた結果となった。セカンダリーは、総じて閑散とした展開であった。CP発行市場は、750億円程度の償還に対して、1,200億円超の発行と発行超となった。小売業態などからの大型発行案件が見られた。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

<< 8日の材料 >>  
 \*1-3月期のGDP2次速報(市場予想:前期比年率+2.7%)  
 \*4月の国際収支 \*4月の特定サービス産業動態統計速報  
 \*5月の景気ウォッチャー調査  
 \*米国5月のFRB労働市場情勢指数  
 \*国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、6/10発行)

当座預金残高		6/5以降の残り所要積立額	
2,107,500			
準備預金残高	1,929,300		5,900
積み終了先	1,627,300	6/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,626,800	積数	2,700
非準備先残高	178,200	1日平均	300
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	2,026,700		
準備預金進捗率	99.87% (実績)		74.19% (日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	124.38-41
0.480 ▲ 0.020	20,460.90 ▲ 27.29	為替(5時)	124.70-72

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	5/29	6/1	6/2	6/3	6/4	6/5
日銀当預残	2,130,200	2,111,900	2,091,000	2,090,500	2,094,500	2,107,500
準備預金残	1,944,600	1,931,900	1,915,600	1,912,700	1,909,500	1,929,300
レート	0.073%	0.073%	0.075%	0.074%	0.073%	0.075%
月中平均	0.06945%	0.07300%	0.07400%	0.07400%	0.07375%	0.07429%

6/4のマナリーベース				3,034,700		
6/4コール	合計	199,191	無担	69,750	有担	129,441
コール前日増減	計	4,558	無担	2,179	有担	2,379

6/5の加重平均レート(速報)				6/4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		有担当日分	
0.060 ~0.080 (0.075)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.055 ~0.125 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.067 ~0.120 (0.084)						T/N		0.067 ~0.120 (0.084)	
						S/N			
0.117 (0.117)						1W	0.091 ~0.117 (0.101)		
0.116 ~0.310 (0.141)						2W			
						3W			
0.170 (0.170)			0.08-0.13	0.0150		1M			有担先日付分
			0.08-0.12	-		2M			
			0.08-0.12	0.0020		3M	0.120 (0.120)		
			-	-		6M			
			-	-		1Y			

## <<オペ情報、入札結果>>

国債補完	1,577億円	6/5	~ 6/8 (3日間)	応札	23億円	落札	23億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	5,000億円	6/9		応札	11,723億円	落札	5,002億円	按分利回り較差	0.000%	26.0%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	3,750億円	6/9		応札	10,599億円	落札	3,752億円	按分利回り較差	0.004%	33.1%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	6/9		応札	10,194億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	-0.008%	97.8%	平均利回り較差	-0.008%
国債買入	2,400億円	6/9		応札	7,408億円	落札	2,406億円	按分利回り較差	-0.017%	3.5%	平均利回り較差	-0.013%
国債買入	1,400億円	6/9		応札	4,126億円	落札	1,401億円	按分利回り較差	-0.027%	3.8%	平均利回り較差	-0.021%

ETF買入 370億円 約定日 6/5

J-REIT買入 13億円 約定日 6/5

「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