

2015/6/10(水)

◀セントラル短資株式会社▶

◀資金需給▶

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想		12日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		300	▲ 700	▲ 1,000		
財政		▲ 11,500	700	2,000		
資金過不足		▲ 11,200	0	1,000		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		68,017				
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					4,700	
CP等買入						
		▲ 1,300	▲ 200			
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 223,470						
被災地支援		3,244				
社債等買入		▲ 100				
ETF買入			200			
国債補充供給	即日	▲ 100				
		100	100			
小計		▲ 1,400	100	4,700		
当増増減		▲ 12,600	100	5,700		

当座預金残高	2,117,800	6/10以降の残り所要積立額	1,000
準備預金残高	1,921,800	6/11以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,622,800	積数	400
超過準備	1,622,300	1日平均	100
非準預先残高	196,000		
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	99.98% (実績)	83.87% (日数)	

6/9のマネタリーベース		3,068,700	
6/9コール	合計	199,928	無担 69,222 有担 130,706
コール前日増減	計	409	無担 ▲ 285 有担 694

6/10の加重平均レート(速報)				6/9の加重平均レート(確報)			
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	有担先日付分
0.055 ~0.125 (0.089)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.122 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.072 ~0.130 (0.083)				T/N	0.071 ~0.120 (0.086)		
				S/N			
0.064 ~0.140 (0.100)				1W	0.200 (0.200)		
0.130 ~0.310 (0.202)				2W	0.142 (0.142)		
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.001-0.001	3M			
		-	▲0.02-▲0.015	6M			
		-	-	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	6,628億円	6/10	~ 6/11 (1日間)	応札	104億円	落札	104億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	700億円	6/12	応札	1,737億円	落札	705億円	按分利回り較差	0.007%	49.1%	平均利回り較差	0.024%
国債買入	4,000億円	6/12	応札	10,330億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	0.036%	39.6%	平均利回り較差	0.041%
社債買入	1,100億円	6/16	応札	2,581億円	落札	1,100億円	按分レート	0.052%	61.1%	平均落札レート	0.092%

J-REIT買入 13億円 約定日 6/10

「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

◀ 6/11の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,117,900	前日比	100
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%近辺での出合いが中心になると予想される。

◀ 10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、162兆円(当座預金残高見込みは211兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、一部業態が大規模な試し取りを行ったため、調達レートが引き上げられ、出合いの中心は地銀、信託の0.075~0.077%となった。一巡後はビッドが薄くなり、0.07%台前半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、ロール案件での出合いが散見される程度であった。

◀ 10日のオープン市場動向 ▶
現先S/N物は横ばい圏で推移。短国市場は、全般的に閑散な中、6Mで▲0.02~▲0.015%、3Mで▲0.001~0.001%と強めの出合いが見られた。CP市場は、食料品・金融業態からの大型発行案件が見られ、1,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。

◀ 11日の材料 ▶
*4-6月期の法人企業景気予測調査季報
*4月のマネタリーサーベイ
*米国4月の企業在庫 *米国5月の小売売上高
*国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、6/15発行)
*20年利付国債入札(12,000億円、6/22発行)

JGB新発10年債	0.505	0.055	日経平均株価(終値)	20,046.36	▲ 49.94	為替(9時)	124.35-37
						為替(5時)	122.70-72

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	6/3	6/4	6/5	6/8	6/9	6/10
日銀当座預金	2,090,500	2,094,500	2,107,500	2,107,500	2,130,400	2,117,800
準備預金残	1,912,700	1,909,500	1,929,300	1,924,500	1,943,500	1,921,800
レート	0.074%	0.073%	0.075%	0.073%	0.074%	0.089%
月年平均	0.07400%	0.07375%	0.07429%	0.07413%	0.07411%	0.07560%