

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/6/11(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	11日需給速報	12日需給予想	15日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 800	▲ 1,000	0
財政	200	▲ 200	86,000
資金過不足	▲ 600	▲ 1,200	86,000
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	▲ 200	▲ 600	
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		▲ 200	
ETF買入	200	200	
国債補完供給	即日 ▲ 100		
	100	100	
小計	0	4,200	0
当預増減	▲ 600	3,000	86,000

当座預金残高	2,117,200	6/11以降の残り所要積立額	400
準備預金残高	1,930,900	6/12以降の残り所要積立額	300
積み終了先	1,633,100	積数	100
超過準備	1,633,100	1日平均	100
非準備先残高	186,300		
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	2,026,800		
準備預金進捗率	99.99% (実績)	87.10% (日数)	

6/10のマネタリーベース		3,055,700	
6/10コール 合計	209,979	無担	79,147
		有担	130,832
コール前日増減 計	10,051	無担	9,925
		有担	126

6/11の加重平均レート(速報)				6/10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 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)					O/N	0.055 ~0.125 (0.089)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.120 (0.082)						T/N		
						S/N	0.072 ~0.130 (0.083)	
0.117 ~0.175 (0.118)						1W	0.140 (0.140)	0.064 ~0.130 (0.096)
0.114 ~0.170 (0.123)						2W		0.130 ~0.310 (0.202)
						3W		
		0.08-0.13	-	1M				有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.001-0.002	3M				
		-	▲0.025-▲0.017	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 2,622億円 6/11 ~ 6/12 (1日間) 応札 121億円 落札 121億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 T-Bill3M 応札15兆1,226億円 落札4兆9,082億2,000万円(非競争入札:4,417億円) 6/15~9/14 0.0020% 按分36.8423% 平均0.0004%
 20年利付国債(表面利率1.3%) 応札2兆7,928億円 落札1兆891億円(I 非競争入札:1,098億円) 6/22~2035/6/20 1.300% 按分9.0316% 平均1.293%

「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

<< 6/12の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,120,200	前日比	3,000
O/N	0.06~0.08	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.075%近辺での出合いが中心になると予想される。

<< 11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、163兆5,000億円(当座預金残高見込みは211兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.075%、大手行からは0.068%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.075~0.077%となった。一巡後は徐々にビッドが消え、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、大手行が1W物0.117%で調達を行った。

<< 11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3M物の入札が実施され、落札結果は平均落札利回0.0004%、按分利回0.002%と、事前予想通り堅調な結果となった。セカンダリーでは一時▲0.001%での出合いが見られたものの、0%の売り気配で引けた。CP市場は、五・十日に係る発行となり、一部で大型の発行案件が見られたが、発行総額は1,000億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

<< 12日の材料 >>

- *4月の第3次産業活動指数
- *4月の石油等消費動態統計
- *米国5月の生産者物価指数
- *米国6月のミシガン大消費者信頼感指数速報

JGB新発10年債	0.535	0.030	日経平均株価(終値)	20,382.97	336.61	為替(9時)	122.88-90
						為替(5時)	123.53-55

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	6/4	6/5	6/8	6/9	6/10	6/11
日銀当預残	2,094,500	2,107,500	2,107,500	2,130,400	2,117,800	2,117,200
準備預金残	1,909,500	1,929,300	1,924,500	1,943,500	1,921,800	1,930,900
レート	0.073%	0.075%	0.073%	0.074%	0.089%	0.074%
月中平均	0.07375%	0.07429%	0.07413%	0.07411%	0.07560%	0.07545%