

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/6/12(金) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	12日需給速報		15日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,000	600	0
財政		0	79,200	4,000
資金過不足		▲ 1,000	79,800	4,000
貸出				
売出手形				
本店共通				
全店共通				
共通(固定)				
68,017				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				10,000
国庫短期証売却				
国債買入		4,700		11,600
CP等買入		▲ 600	▲ 400	
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	▲ 100	1,100
ETF買入		200	300	
国債補完供給	即日	▲ 200		
		100	200	
小計		4,000	0	22,700
当預増減		3,000	79,800	26,700

当座預金残高	2,120,200	6/12以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,943,300		300
積み終了先	1,645,300	6/15以降の残り所要積立額	
超過準備	1,645,300	積数	0
非準預先残高	176,900	1日平均	0
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	100.00% (実績)		96.77% (日数)

6/11のマナタリーベース		3,055,900	
6/11コール 合計	201,603	無担	69,823
有担	131,780		
コール前日増減	計	▲ 8,376	無担 ▲ 9,324
			有担 948

6/12の加重平均レート(速報)			6/11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
0.030 ~0.080 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.080 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.120 (0.080)				T/N	0.072 ~0.120 (0.082)	
				S/N		
0.116 ~0.117 (0.117)				1W	0.117 ~0.175 (0.118)	
0.115 ~0.118 (0.116)				2W	0.114 ~0.170 (0.123)	
				3W		
0.145 (0.145)		0.08-0.13	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	-	3M		
		-	▲0.022	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,603億円	6/12	~ 6/15 (3日間)	応札	155億円	落札	155億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	10,000億円	6/16		応札	24,455億円	落札	10,000億円	全取利回り較差	0.006%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	3,750億円	6/16		応札	11,463億円	落札	3,752億円	按分利回り較差	0.005%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	6/16		応札	8,738億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.015%	平均利回り較差	-0.014%
国債買入	2,400億円	6/16		応札	6,005億円	落札	2,402億円	按分利回り較差	-0.029%	平均利回り較差	-0.020%
国債買入	1,400億円	6/16		応札	5,263億円	落札	1,401億円	全取利回り較差	-0.019%	平均利回り較差	-0.013%

J-REIT買入 13億円 約定日 6/12

<< 6/15の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,200,000	前日比	79,800
O/N	0.06~0.08	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.07%台での出合いが中心になると予想される。

<< 12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212兆円)。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%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.076~0.078%と昨日よりも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消え、0.07%台前半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、昨日に続き大手行が1W物0.117%で調達を行った。

<< 12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、短国買入オペが前回から5,000億円増額となる1兆円でオファーされた。平均利回較差・全取利回較差が共に+0.006%となるなど、特定銘柄が応札されたとみられる結果となった。セカンダリーでは、6Mで▲0.022%での出合いがみられた。CP市場は、950億円程度の償還に対して、700億円強の発行となった。発行レートについては、地合いに特段の変化は無く、月内償還物を中心に小高い水準での決着となった。

<< 15日の材料 >>
 *米国5月の鉱工業生産・設備稼働率

JGB新発10年債	0.500	▲ 0.035	日経平均株価(終値)	20,407.08	24.11	為替(9時)	123.59-61
						為替(5時)	123.71-73

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	6/5	6/8	6/9	6/10	6/11	6/12
日銀当預残	2,107,500	2,107,500	2,130,400	2,117,800	2,117,200	2,120,200
準備預金残	1,929,300	1,924,500	1,943,500	1,921,800	1,930,900	1,943,300
レート	0.075%	0.073%	0.074%	0.089%	0.074%	0.074%
月中平均	0.07429%	0.07413%	0.07411%	0.07560%	0.07545%	0.07514%

「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