CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/6/17(水)　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想	19日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 800	▲ 1,700	▲ 2,000
財政		1,300	2,200	1,000
資金過不足		500	500	▲ 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				
CP等買入		▲ 200	▲ 300	3,500
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 223,470				21,600 ▲ 200
被災地支援 3,244				
社債等買入				
ETF買入		200	200	
国債補完供給	即日	▲ 200 200	200	
小計		0	100	24,900
当預増減		500	600	23,900

当座預金残高	2,227,400	6/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,029,900		686,200
積み終了先	1,544,500	6/18以降の残り所要積立額	
超過準備	1,215,400	積数	192,300
非準預先残高	197,500	1日平均	6,900
積み期間(6/16～7/15)の所要準備額(積数)			1,955,500

準備預金進捗率　90.17%　(実績)　6.67%　(日数)

6/16のマネタリーベース				3,166,000		
6/16コール	合計	199,079	無担	68,853	有担	130,226
コール前日増減	計	▲ 4,809	無担	▲ 3,681	有担	▲ 1,128

≪ 6/18の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,228,000	前日比	600
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%台での出合いが中心になると予想される。

≪ 17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、171兆6,000億円(当座預金残高見込みは、過去最高の222兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07～0.075%、大手行からは0.065%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.073～0.075%となった。一巡後は調達レートが低下し、0.07%近辺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。

≪ 17日のオープン市場動向 ≫

現先取引S/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は1Y物の入札が実施され、各落札利回りは平均▲0.0150%、按分▲0.0100%と事前予想より強めの結果となった。セカンダリー市場では▲0.020%でまとまった取引が見られた。CP市場は20日にかかる取引となったことで、複数の鉄鋼業態からまとまった発行が見られ、発行総額は3,000億円程度に上った。昨日のCP等買入オペの上昇を受け、発行水準は期間が短い案件を中心に若干上昇した。

≪ 18日の材料 ≫

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、19日まで)
*米国5月の消費者物価指数
*国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、6/22発行)
*40年利付国債入札(4,000億円、6/22発行)

≪コール5月積み期間分の加重平均レート≫

(土日を含む)	無担	0.07294%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07300%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	
0.475	▲ 0.020

日経平均株価(終値)	
20,219.27	▲ 38.67

為替(9時)	123.45-47
為替(5時)	123.64-66

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	6/10	6/11	6/12	6/15	6/16	6/17
日銀当預残	2,117,800	2,117,200	2,120,200	2,198,500	2,226,900	2,227,400
準備預金残	1,921,800	1,930,900	1,943,300	2,013,200	2,031,600	2,029,900
レート	0.089%	0.074%	0.074%	0.073%	0.073%	0.076%
月中平均	0.07560%	0.07545%	0.07514%	0.07500%	0.07488%	0.07494%

6/17 の加重平均レート(速報)

無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国	
0.055 ～0.125 (0.076)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N
0.072 ～0.074 (0.074)				T/N
				S/N
0.064 ～0.130 (0.081)				1W
0.130 ～0.160 (0.135)				2W
				3W
		0.08-0.13	-	1M
		0.08-0.12	-	2M
		0.08-0.12	0.0000	3M
		-	-	6M
		-	▲0.020-▲0.009	1Y

6/16 の加重平均レート(確報)　単位 (%)

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)
	0.072 ～0.120 (0.075)	
	0.092 ～0.340 (0.131)	
	0.180 (0.180)	
		有担先日付分

≪オペ情報、入札結果≫

国債補完　6,546億円　6/17　～　6/18　(1日間)　応札　217億円　落札　217億円　-0.400%　全 取　平 均　-0.400%　(即)
国債買入　3,750億円　6/22　応札　12,448億円 落札　3,750億円　全取利回り較差　0.006%　平均利回り較差　0.006%
国債買入　4,000億円　6/22　応札　15,589億円 落札　4,003億円　按分利回り較差　-0.002%　42.4%　平均利回り較差　0.000%
国債買入　4,000億円　6/22　応札　12,214億円 落札　4,011億円　按分利回り較差　-0.014%　18.4%　平均利回り較差　-0.013%
T-Bill1Y　応札10兆2,007億円 落札2兆3,047億7,000万円(非競争入札:1,952億円) 6/22～2016/6/20 ▲0.0100% 按分26.8461% 平均▲0.0150%
交付税特会　1兆500億円　6/25～12/24　応札 2兆6,600億円　落札1兆500億円　0.090% 按分90.0000% 平均0.083%
貸出増加支援　6/19～2016/6/20 (367日間)　貸付予定総額　198億円　貸付利率 0.10%
貸出増加支援　6/19～2017/6/20 (732日間)　貸付予定総額　0億円　貸付利率 0.10%
貸出増加支援　6/19～2019/6/19 (1461日間)　貸付予定総額 21,369億円　貸付利率 0.10%
ETF買入　370億円　約定日 6/17

「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