

2015/6/19(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	19日需給速報 即日 金額	22日需給予想 金額	23日当社予想 金額
銀行券	▲ 1,700	▲ 100	▲ 1,000
財政	▲ 300	17,700	3,000
資金過不足	▲ 2,000	17,600	2,000
貸出			
売出手形 0			
本店共通 0			
全店共通 0			
共通(固定) 68,017		1,100 ▲ 1,100	
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		11,900	
CP等買入	3,500 ▲ 400	▲ 600	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836	21,600 ▲ 13,900		
被災地支援 3,244			
社債等買入	▲ 600	▲ 200	
ETF買入	300	200	
国債補完供給	即日 ▲ 100 200	100	
小計	10,600	11,400	0
当預増減	8,600	29,000	2,000

当座預金残高	2,235,800	6/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,030,700		105,700
積み終了先	1,700,400	6/22以降の残り所要積立額	
超過準備	1,686,400	積数	30,300
非準備先残高	205,100	1日平均	1,300
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	98.45%	(実績)	20.00% (日数)

6/18のマネタリーベース	3,168,900
6/18コール 合計	197,535 無担 68,874 有担 128,661
コール前日増減 計	580 無担 ▲ 1,120 有担 1,700

6/19 の加重平均レート(速報)				6/18 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	
0.055 ~0.080 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.055 ~0.125 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.072 ~0.120 (0.076)				T/N		0.072 ~0.125 (0.079)		
				S/N				
0.098 ~0.310 (0.115)				1W		0.075 (0.075)		
0.180 (0.180)				2W				
				3W				
		0.08-0.13	-	1M	0.170 (0.170)	0.145 ~0.280 (0.168)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.0000	3M				
		-	▲0.020	6M				
		-	▲0.060-▲0.030	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完 2,495億円 6/19 ~ 6/22 (3日間) 応札 79億円 落札 79億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

<<日銀金融政策決定会合・結果>>

- マネタリーベースが、年間約80兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(賛成8反対1)
- 資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)
 - ①長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。買入れの平均残存期間は7年~10年程度とする。
 - ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約3兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 - ③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。
- 金融政策決定会合の運営の見直しについて(2016年1月から実施)(全員一致)
 - ①「経済・物価情勢の展望」(展望レポート)の年4回化(1月、4月、7月、10月の金融政策決定会合終了後に公表)
 - ②政策委員全員の経済・物価見通し及びリスク評価の公表 ③「主な意見」の公表(金融政策決定会合終了後1週間を目途に公表)
 - ④金融政策決定会合の開催頻度の見直し(年14回程度→年8回)

「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

《 6/22の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,264,800	前日比	29,000
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。					

《 19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、171兆5,000億円(当座預金残高見込みは、過去最高の223兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.073~0.077%、大手行からは0.07%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.073~0.077%となった。一巡後は調達レートが低下し、0.07~0.072%程度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物の調達を行った。金融政策決定会合では金融調節方針の現状維持が決定された。また、金融政策決定会合の運営の見直しが行われた。

《 19日のオープン市場動向 》

現先取引S/Nは概ね横ばい圏で推移。短国市場は短国買入オペを睨んだ購入姿勢が強く、1Y物が▲0.03%から▲0.06%まで買い進まれ大幅に強含んだ。CP発行市場は機械業態などからまとまった額の案件が見られたものの、件数は少なめで発行総額は900億円程度にとどまった。レート水準に特段変化は見られなかった。

《 22日の材料 》

- *金融経済月報
- *米国5月の中古住宅販売

《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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	122.99-02
0.415 ▲ 0.020	20,174.24 183.42	為替(5時)	123.11-13

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	6/12	6/15	6/16	6/17	6/18	6/19
日銀当預残	2,120,200	2,198,500	2,226,900	2,227,400	2,227,200	2,235,800
準備預金残	1,943,300	2,013,200	2,031,600	2,029,900	2,032,600	2,030,700
レート	0.074%	0.073%	0.073%	0.076%	0.074%	0.074%
月中平均	0.07514%	0.07500%	0.07488%	0.07494%	0.07489%	0.07476%