

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/6/22(月)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	22日需給速報		23日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 1,300	▲ 2,000
財政		12,200	2,500	4,000
資金過不足		12,100	1,200	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,100		
68,058		▲ 1,100		
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		11,900		7,800
CP等買入				
		▲ 600	▲ 400	
貸出支援基金(成長) 48,511(増加) 244,836				
被災地支援				
3,244				
社債等買入		▲ 200	▲ 100	
ETF買入		200	100	
国債補完供給	即日	▲ 800		
		100	800	
小計		10,600	400	17,800
当増減		22,700	1,600	19,800

当座預金残高	2,258,500	6/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,065,500		30,300
積み終了先	1,709,300	6/23以降の残り所要積立額	
超過準備	1,705,300	積数	17,000
非準備先残高	193,000	1日平均	700
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	99.13% (実績)	23.33% (日数)	

6/19のマネタリーベース		3,179,100	
6/19コール	合計	194,403	無担 63,859 有担 130,544
コール前日増減	計	▲ 3,132	無担 ▲ 5,015 有担 1,883

6/22 の加重平均レート(速報)				6/19 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		有担当日分	
0.030 ~0.130 (0.073)	0.030	~0.040 (0.031)					O/N	0.055 ~0.080 (0.074)	
0.070 ~0.120 (0.077)					T/N		0.072 ~0.120 (0.076)		
					S/N				
0.117 (0.117)					1W		0.098 ~0.310 (0.117)		
0.114 (0.114)					2W		0.180 (0.180)		
					3W				
				0.08-0.13	-	1M		有担先日付分	
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	▲0.002-0.000	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

《オペ情報、入札結果》

国債補完	8,000億円	6/22	~	6/23 (1日間)	応札 115億円	落札 115億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債補完	24,253億円	6/22	~	6/23 (1日間)	応札 631億円	落札 631億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	10,000億円	6/24	応札	17,811億円	落札 10,000億円	全取利回り較差	0.011%		平均利回り較差	0.012%
国債買入	4,000億円	6/24	応札	12,141億円	落札 4,010億円	按分利回り較差	0.002%	41.3%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,400億円	6/24	応札	8,761億円	落札 2,404億円	按分利回り較差	-0.002%	83.8%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	1,400億円	6/24	応札	3,172億円	落札 1,403億円	按分利回り較差	-0.033%	94.3%	平均利回り較差	-0.022%
被災地支援(第50回)	6/26~2016/6/24 (364日間)	貸付予定総額	543億円	貸付利率	0.10%					

《 6/23の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,260,100	前日比	1,600
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。

《 22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、172兆7,000億円(当座預金残高見込みは、過去最高の226兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.075%、大手行からは0.07%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.072~0.075%となった。一巡後は調達レートが低下し、0.07%前後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、ロール案件中心の取引となった。

《 22日のオープン市場動向 》

現先レートは横ばいで推移した。短国市場は短国買入オペが10,000億円で行われた。結果は平均利回り較差+0.012%、全取利回り較差+0.011%と引け値の低い特定銘柄が応札されたとみられる結果となった。CP市場は、鉄鋼、電気機器業態からまとまった発行があり、発行総額は1,400億円程度まで膨らんだ。発行レートは期間にかかわらず横ばいであった。

《 23日の材料 》

- *米国5月の新築一戸建て販売件数
- *米国5月の耐久財新規受注
- *流動性供給入札(5,000億円、6/25発行)

JGB新発10年債	0.425	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	20,428.19	253.95	為替(9時)	122.77-79
						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	6/15	6/16	6/17	6/18	6/19	6/22
日銀当預残	2,198,500	2,226,900	2,227,400	2,227,200	2,235,800	2,258,500
準備預金残	2,013,200	2,031,600	2,029,900	2,032,600	2,030,700	2,065,500
レート	0.073%	0.073%	0.076%	0.074%	0.074%	0.073%
月中平均	0.07500%	0.07488%	0.07494%	0.07489%	0.07476%	0.07468%

「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