

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/6/26(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	26日需給速報		29日需給予想		30日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,300	▲ 700	▲ 300		
財政		3,500	▲ 100	3,300		
資金過不足		1,200	▲ 800	3,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					700	
68,058					▲ 7,600	
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		11,800			11,600	
CP等買入					4,000	
		▲ 600			▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836						
被災地支援		500				
3,241		▲ 500				
社債等買入						
ETF買入		500		100		
国債補完供給		100				
小計		11,800		▲ 300	18,700	
当増減		13,000		▲ 1,100	21,700	

6/29の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,284,000	前日比	▲ 1,100
O/N	0.06~0.075	T/N	0.03~0.12	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。

《 26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、173兆4,000億円(当座預金残高見込みは、過去最高の228兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.077%、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、0.07~0.074%程度で推移した。ターム物に関しては、ロール案件中心の取引となった。

《 26日のオープン市場動向 》  
 現先レートは横ばいで推移。短国市場は、短国買入オペが10,000億円で実施され、平均利回較差+0.002%、全取利回較差±0.000%と、堅調なマーケットを反映した落ち着いた結果になった。CP市場は、月末発行となり石油、不動産、鉄鋼業態からまとまった発行があり、発行総額は9,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移したが、発行額の大きい案件では、一部で上昇する物もみられた。

《 29日の材料 》  
 \*5月の商業動態統計速報  
 \*5月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲0.8%)

当座預金残高	2,285,100	6/26以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,078,600		7,000
積み終了先	1,732,900	6/29以降の残り所要積立額	
超過準備	1,731,800	積数	3,000
非準預先残高	206,500	1日平均	200
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)			1,955,800
準備預金進捗率	99.85% (実績)		43.33% (日数)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	123.59-61
0.470	0.000	20,706.15	▲ 65.25	為替(5時)	123.36-37

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	6/19	6/22	6/23	6/24	6/25	6/26
日銀当預残	2,235,800	2,258,500	2,259,300	2,276,500	2,272,100	2,285,100
準備預金残	2,030,700	2,065,500	2,063,500	2,073,300	2,065,700	2,078,600
レート	0.074%	0.073%	0.074%	0.077%	0.073%	0.073%
月中平均	0.07476%	0.07468%	0.07465%	0.07475%	0.07468%	0.07450%

6/25のマナタリーベース				3,220,900		
6/25コール	合計	198,210	無担	68,751	有担	129,459
コール前日増減	計	▲ 782	無担	▲ 244	有担	▲ 538

6/26の加重平均レート(速報)				6/25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	
0.030 ~ 0.125 (0.073)	0.030	~ 0.040 (0.031)				0.030 ~ 0.125 (0.073)		0.030 ~ 0.040 (0.031)	
0.068 ~ 0.120 (0.078)							0.068 ~ 0.125 (0.090)		
0.180 (0.180)									
0.145 (0.145)							0.117 (0.117)		
				0.08-0.13	-			0.260 (0.260)	有担先日付分
				0.08-0.12	-				
0.200 (0.200)				0.08-0.12	0.000-0.001				
				-	-				
				-	-				

《オペ情報、入札結果》

全店共通	15,000億円	6/30	~ 10/9 (101日間)	応札	733億円	落札	733億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	7,382億円	6/26	~ 6/29 (3日間)		0億円		0億円		按分	平均	(即)
国短買入	10,000億円	6/30	応札	25,335億円	落札	10,005億円		按分利回り較差	5.1%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	3,750億円	6/30	応札	10,436億円	落札	3,752億円		按分利回り較差	18.0%	平均利回り較差	-0.010%
国債買入	4,000億円	6/30	応札	14,728億円	落札	4,000億円		全取利回り較差	0.007%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	2,400億円	6/30	応札	6,025億円	落札	2,402億円		按分利回り較差	-0.003%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	1,400億円	6/30	応札	4,308億円	落札	1,402億円		按分利回り較差	-0.002%	平均利回り較差	0.003%
ETF買入	370億円	約定日	6/26								

「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