

2015/7/2(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	6日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 800	1,000
財政		▲ 29,800	5,800	▲ 21,000
資金過不足		▲ 30,400	5,000	▲ 20,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			9,100	1,800
61,199			▲ 3,900	▲ 2,300
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			8,700	
CP等買入				
		▲ 100	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援				
3,241				
社債等買入				
ETF買入		100	200	
国債補完供給	即日	▲ 100		
		200	100	
小計		100	13,800	▲ 500
当増減		▲ 30,300	18,800	▲ 20,500

当座預金残高	2,268,300	7/2以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,054,400		1,900
積み終了先	1,713,800	7/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,713,800	積数	1,600
非準備先残高	213,900	1日平均	100
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)			1,953,900
準備預金進捗率	99.92% (実績)	56.67% (日数)	

7/1のマナタリーベース		3,251,200	
7/1コール	合計	196,076	無担 62,944 有担 133,132
コール前日増減	計	▲ 3,828	無担 8,261 有担 ▲ 12,089

7/2の加重平均レート(速報)			7/1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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.020 ~0.125 (0.072)	0.030 ~0.040 (0.031)		0.020 ~0.125 (0.062)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.125 (0.080)				0.050 ~0.120 (0.066)		
				0.059 ~0.122 (0.100)		
0.118 ~0.145 (0.122)			0.117 (0.117)	0.118 (0.118)		
			2W			
			3W			
0.144 ~0.170 (0.161)		0.08-0.13	1M	0.170 (0.170)	有担先日付分	
		0.08-0.12	2M			
		0.08-0.12	▲0.0024-0.00			
		-	3M			
		-	6M			
		-	1Y			

<< 7/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,287,100	前日比	18,800
O/N	0.065~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.065~0.12

無担O/Nは0.065~0.075%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 2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、前日比3兆4,000億円減少の171兆3,000億円(当座預金残高見込みは226兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.065~0.069%近辺、地銀・信託業態から0.073%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.073%近辺の出合いが中心となった。大手行のビッドが下支えとなり、一巡後も0.07~0.073%の出合いを中心に底堅く推移した。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<< 2日のオープン市場動向 >>
 現先レートは低位安定。短国市場は3M物の入札が実施され、平均落札利回▲0.0024% 按分落札利回0.000%と事前予想通りの結果となった。セカンダリーはショートカバーから平均落札利回近辺での出合いがみられたものの、買い一巡後は0%での出合いが散見されるにとどまった。CP市場は、償還総額700億円程度に対し発行総額は1,300億円程度となった。発行レートは、積極的な購入ニーズに乏しく、概ね横ばい圏での動きとなった。

<< 3日の材料 >>
 *米国休日(Independence Day)

<<コール6月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07230%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07168%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.510	0.040	日経平均株価(終値)	20,522.50	193.18	為替(9時)	123.32-34
						為替(5時)	123.48-50

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	6/25	6/26	6/29	6/30	7/1	7/2
日銀当座預残	2,272,100	2,285,100	2,283,200	2,298,400	2,298,600	2,268,300
準備預金残	2,065,700	2,078,600	2,077,100	2,086,100	2,084,900	2,054,400
レート	0.073%	0.073%	0.072%	0.011%	0.062%	0.072%
月中平均	0.07468%	0.07450%	0.07441%	0.07230%	0.06200%	0.06700%

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 7/6 ~ 10/5 (91日間) 応札 1,800億円 落札 1,800億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 国債補完 4,000億円 7/2 ~ 7/3 (1日間) 応札 50億円 落札 50億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 T-Bill3M 応札16兆3,965億5,000万円 落札4兆6,955億2,000万円(非競争入札:4,244億円) 7/6~10/5 0.000% 按分18.0320% 平均▲0.0024%
 10年利付国債(表面利率0.4%) 応札5兆7,168億円 落札2兆1,830億円(I非競争入札:2,109億円) 7/6~2025/6/20 0.517% 按分98.9443% 平均0.513%

「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