

2014/6/16(月)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	16日需給速報 即日 金額	17日需給予想 金額	18日当社予想 金額
銀行券	600	300	▲ 1,000
財政	▲ 25,100	3,000	1,000
資金過不足	▲ 24,500	3,300	0
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)	1,400		
118,159	▲ 1,700		
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			
CP等買入			
	▲ 400	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 85,512			
被災地支援			
3,782			
社債等買入		800	
ETF買入			
国債補完供給			
小計	▲ 700	600	10,000
当預増減	▲ 25,200	3,900	10,000
当座預金残高	1,389,300	6/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,258,600		1,841,700
積み終了先	334,900	6/17以降の残り所要積立額	
超過準備	271,100	積数	1,040,200
非準備先残高	130,700	1日平均	35,900
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)			1,841,700
準備預金進捗率	43.52%	(実績)	3.33% (日数)

6/13のマネタリーベース		2,314,300	
6/13コール	合計	152,605	無担 57,372 有担 95,233
コール前日増減	計	1,105	無担 155 有担 950

6/16 の加重平均レート(速報)				6/13 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	
0.040 ~0.125 (0.067)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N	0.055 ~0.090 (0.069)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.065 ~0.120 (0.072)				T/N		0.065 ~0.125 (0.082)		
				S/N				
0.117 ~0.400 (0.145)				1W				
				2W		0.118 (0.118)		
				3W				
0.150 (0.150)		0.08-0.13	-	1M		0.118 ~0.121 (0.120)	有担先日付分	
		0.08-0.13	0.0350	2M				
		0.08-0.13	-	3M				
		-	-	6M				
		-	0.0340	1Y				

《オペ情報、入札結果》

CP買入	4,500億円	6/19	応札	4,434億円	落札	4,014億円	全取レート	0.001%	平均落札レート	0.080%
国短買入	10,000億円	6/18	応札	23,410億円	落札	10,003億円	按分利回り較差	-0.001%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	3,000億円	6/20	応札	12,745億円	落札	3,004億円	按分利回り較差	0.003%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,000億円	6/20	応札	7,890億円	落札	2,005億円	按分利回り較差	0.002%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	4,000億円	6/20	応札	14,742億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.006%	平均利回り較差	-0.005%

「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

《 6/17の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,393,200	前日比	3,900
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心となろう。

《 16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3兆1,000億円減少の107兆2,000億円(当預金残高見込みは139兆円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06~0.063%、地銀・信託業態から0.065~0.066%、証券業態から0.066~0.067%の調達希望。立ち上がりは0.065~0.066%を中心とした出合い。新しい積み期の初日であったが、参加者の調達姿勢に特段の変化は無く、一巡後も0.06%台の出合いで底堅く推移した。ターム物では、1W~1M物の期間で大手行からの幅広い調達が見られた。

《 16日のオープン市場動向 》

現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は短国買入オペが実施され、オフア額が前回比5,000億円減額の10,000億円となったものの、平均利回較差、按分利回較差共に▲0.001%と落着いた結果となった。CP市場は、不動産、ノンバンク、石油業態からまとまった発行が見られ、発行総額は1,900億円程度となった。発行レートは概ね横ばいで推移。CP等買入オペは4,500億円で実施されたものの、応札可能な銘柄が少なく、平均落札利回り0.080%、全取落札利回り0.001%と過去最低のレートになった。

《 17日の材料 》

- *米国FOMC(1日目)
- *ECB定例理事会(1日目、金融政策発表なし)
- *米国5月の消費者物価指数 *米国5月の住宅着工件数
- *英国5月の消費者物価指数
- *20年利付国債入札(12,000億円、6/20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	0.06877%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06895%	有担	0.04100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	101.96-98
0.595	▲ 0.005	14,933.29	▲ 164.55	為替(5時)	101.92-93

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	6/9	6/10	6/11	6/12	6/13	6/16
日銀当預残	1,351,300	1,352,500	1,367,800	1,366,000	1,414,500	1,389,300
準備預金残	1,222,700	1,219,400	1,235,200	1,236,600	1,287,200	1,258,600
レート	0.069%	0.070%	0.071%	0.071%	0.069%	0.067%
月中平均	0.06789%	0.06810%	0.06836%	0.06858%	0.06867%	0.06856%