

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/2/21(金)

<<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	21日需給速報		24日需給予想	25日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,100	▲ 300	0
財政		▲ 9,400	▲ 20,600	0
資金過不足		▲ 11,500	▲ 20,900	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			2,200	
165,942			▲ 8,800	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				25,000
国庫短期証売却				
国債買入			7,100	
CP等買入		▲ 600	▲ 100	
貸出支援基金(成長)				
34,599				
(増加) 50,859				
被災地支援				
3,805				
社債等買入			▲ 200	
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		▲ 500	300	25,000
当預増減		▲ 12,000	▲ 20,600	25,000

当座預金残高	1,120,600	2/21以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,014,900		193,600
積み終了先	862,900	2/24以降の残り所要積立額	
超過準備	860,400	積数	123,400
非準備先残高	105,700	1日平均	6,200
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)			1,689,700
準備預金進捗率	92.70% (実績)		28.57% (日数)

2/20のマネタリーベース		2,032,100	
2/20コール	合計	172,639	無担 67,045 有担 105,594
コール前日増減	計	2,602	無担 1,397 有担 1,205

2/21の加重平均レート(速報)				2/20の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.055 ~0.145 (0.079)	0.040 ~0.050 (0.041)	CP気配a-1	短国	O/N 0.050 ~0.145 (0.086)			有担当当日分
0.070 ~0.120 (0.079)					0.070 ~0.120 (0.086)		
0.117 (0.117)					0.118 (0.118)		
		0.08-0.13	-				有担先日付分
		0.08-0.13	-				
		0.08-0.13	-				
		-	-				
		-	-				

<< 2/24の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,100,000	前日比	▲ 20,600
O/N	0.06~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07%前後の出合いが中心となろう。

<< 21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は、前日比2,000億円増加の88兆円(当座預金残高見込は112兆1,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06~0.065%、地銀および信託業態から0.07%付近のビッドで、0.07~0.071%中心の取引から始まった。地銀業態を中心に資金余剰感強く、落ち着いた水準からの立ち上がりとなった。出し取り一巡後は0.065%前後の散発的な取引で推移。午後は一部調整の動きが見られた程度で特段の動意はなく、一日の取引を終了した。ターム物はロールオーバー案件中心の取引となった。

<< 21日のオープン市場動向 >>  
 現先レートは小高く推移。短国アウトライト市場は短国買入オペが実施された。5,000億円増額の25,000億円となったこともあり、平均利回較差+0.002%、按分利回較差±0.000%と概ね市場実勢通りの落ち着いた結果となった。CP発行市場は25日発行となったことで3,000億円程度の出合い。引き続き期越えの案件は少ない。

<< 24日の材料 >>  
 \*1月のユーロ圏消費者物価指数改定値

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.32-33
0.595 0.010	14,865.67 416.49	為替(5時)	102.50-51

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	2/14	2/17	2/18	2/19	2/20	2/21
日銀当預残	1,159,800	1,135,200	1,131,500	1,138,100	1,132,600	1,120,600
準備預金残	1,050,500	1,017,300	1,025,800	1,025,100	1,018,800	1,014,900
レート	0.071%	0.075%	0.071%	0.079%	0.086%	0.079%
月中平均	0.07438%	0.07441%	0.07422%	0.07447%	0.07505%	0.07557%

## <<オペ情報、入札結果>>

国短買入 25,000億円 2/25 応札 58,211億円 落札 25,003億円 按分利回り較差 0.000% 64.0% 平均利回り較差 0.002%  
 被災地支援(第34回) 2/27~2015/2/27 (365日間) 貸付予定総額0億円 貸付利率0.10%  
 流動性供給 応札 1兆4,280億円 落札 2,997億円 2/25 按分利回り較差 ▲0.007% 按分 48.1250% 平均利回較差 ▲0.009%

「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