

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/2/24(月)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	24日需給速報	25日需給予想	26日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 500	▲ 600	▲ 1,000
財政	▲ 21,800	4,100	2,000
資金過不足	▲ 22,300	3,500	1,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)	2,200		
159,338	▲ 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		9,000
CP等買入	▲ 100	▲ 400	
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	▲ 400	
ETF買入	100		
国債補充供給			
小計	300	24,200	9,000
当増減	▲ 22,000	27,700	10,000

当座預金残高	1,098,600	2/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	997,500		123,400
積み終了先	851,800	2/25以降の残り所要積立額	
超過準備	847,400	積数	104,600
非準備先残高	101,100	1日平均	5,500
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)			1,689,600
準備預金進捗率	93.81% (実績)	32.14% (日数)	

2/21のマナティーベース				2,022,200		
2/21コール 合計	167,293	無担	63,641	有担	103,652	
コール前日増減	計	▲ 5,346	無担	▲ 3,404	有担	▲ 1,942

2/24の加重平均レート(速報)			2/21の加重平均レート(確報)				単位 (%)
無担(平均)	有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.050 ~0.145 (0.073)	0.040	~0.050 (0.041)	0.055 ~0.145 (0.079)		0.070 ~0.120 (0.079)		
0.070 ~0.125 (0.084)							
0.117 ~0.400 (0.259)			0.117		(0.117)		
0.170 ~0.330 (0.234)							
			0.08-0.13	0.0450			
			0.08-0.13	0.0475			
			0.08-0.13	-			
			-	-			
0.260 (0.260)			-	-			
			-	-			
			-	-			
			-	-			

《オペ情報、入札結果》

CP買入	4,000億円	2/27	応札	5,930億円	落札	3,444億円	按分レート	0.081%	12.4%	平均落札レート	0.087%
国債買入	2,500億円	2/26	応札	10,562億円	落札	2,503億円	按分利回り較差	-0.004%	70.0%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	2,500億円	2/26	応札	11,384億円	落札	2,504億円	按分利回り較差	-0.002%	75.9%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	4,000億円	2/26	応札	12,746億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	-0.018%	49.8%	平均利回り較差	-0.015%

「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お客様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

《 2/25の日銀調節とレート予想 》

日銀調節	見送り	当座預金残高	1,126,300	前日比	27,700
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。					

《 24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、前営業日比1兆4,000億円減少の86兆6,000億円(当座預金残高見込は110兆円)。無担O/Nは大手行から0.06%、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。先週に引き続き、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0.06~0.065%程度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。

《 24日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは0.08%近辺で前日から横ばい圏の気配。短国アウトライト市場は1M:0.045%、2M:0.0475%の出合いが見られた。短国買入オペや入札等のイベントが無く、閑散。CP市場は、発行総額900億円程度と少なく、動意薄。CP等買入オペが実施され、平均レート0.087%、按分レート0.081%、按分比率12.4%という結果になった。現先レートが落ちていることもあり、按分レートは前回より小幅低下した。

《 25日の材料 》

- *1月の企業向けサービス価格指数
- *米国2月のCB消費者信頼感指数
- *米国12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- *40年利付国債入札(4,000億円、2/27発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、3/5借入)

JGB新発10年債	0.590 ▲ 0.005
-----------	---------------

日経平均株価(終値)	14,837.68 ▲ 27.99
------------	-------------------

為替(9時)	102.54-55
為替(5時)	102.28-29

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	2/17	2/18	2/19	2/20	2/21	2/24
日銀当預残	1,135,200	1,131,500	1,138,100	1,132,600	1,120,600	1,098,600
準備預金残	1,017,300	1,025,800	1,025,100	1,018,800	1,014,900	997,500
レート	0.075%	0.071%	0.079%	0.086%	0.079%	0.073%
月中平均	0.07441%	0.07422%	0.07447%	0.07505%	0.07557%	0.07546%

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