

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/2/25(火)

<<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	25日需給速報		26日需給予想	27日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 700	▲ 1,300	▲ 1,000
財政		4,900	300	▲ 3,000
資金過不足		4,200	▲ 1,000	▲ 4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
159,338				
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			9,100	
CP等買入				3,400
		▲ 400	▲ 200	
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		▲ 400		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		24,200	8,900	3,400
当預増減		28,400	7,900	▲ 600

当座預金残高	1,127,000	2/25以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,016,300		104,600
積み終了先	870,000	2/26以降の残り所要積立額	
超過準備	868,700	積数	89,500
非準備先残高	110,700	1日平均	5,000
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	94.70% (実績)		35.71% (日数)

2/24のマネタリーベース		2,000,700	
2/24コール	合計	164,134	無担 60,331 有担 103,803
コール前日増減	計	▲ 3,159	無担 ▲ 3,310 有担 151

2/25の加重平均レート(速報)				2/24の加重平均レート(確報)			
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	有担先日付分
0.050 ~0.145 (0.080)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.050 ~0.145 (0.073)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.067 ~0.120 (0.082)					0.070 ~0.125 (0.084)		
0.150 (0.150)							
0.200 (0.200)					0.117 ~0.400 (0.259)		
0.330 (0.330)					0.170 ~0.330 (0.234)		
0.100 ~0.147 (0.125)		0.08-0.13	0.045-0.05				有担先日付分
		0.08-0.13	-				
		0.08-0.13	0.0425		0.190 ~0.260 (0.208)		
		-	-				
		-	-				

## <<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 2/27~3/6 (7日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.560%  
40年利付国債(表面利率1.9%) 応札1兆4,713億円 落札3,992億円 2/27~2053/3/20/1.725% 按分 59.5588%

「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

<< 2/26の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,134,900	前日比	7,900
O/N	0.06~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.07~0.12

T+3スタートの1M物が3月末越えとなるため、レート形成には注意したい。O/Nは落ち着いた展開となろう。

<< 25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2兆円増加の88兆6,000億円(当座預金残高見込は112兆6,000億円)。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%中心の取引から始まった。昨日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。午後是一部調整の動きが見られた程度で、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。

<< 25日のオープン市場動向 >>  
現先レートS/Nは0.075~0.08%程度で、前日からほぼ変わらず。短国アウトライト市場は1M:0.045~0.05%、3M:0.0425%の出会い。前日に続いてイベントが無く、閑散との印象。CP市場は、月末の前倒し発行等、大型の発行案件も散見され、発行総額2,600億円程度。前日のCP等買入オペの影響は見られず、発行レートは横ばい圏。

<< 26日の材料 >>  
\*石田日銀審議委員、埼玉県金融経済懇談会にて講演  
\*米国1月の新築一戸建て販売件数  
\*英国10-12月期のGDP改定値

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.49-51
0.585 ▲ 0.005	15,051.60 213.92	為替(5時)	102.32-33

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	2/18	2/19	2/20	2/21	2/24	2/25
日銀当預残	1,131,500	1,138,100	1,132,600	1,120,600	1,098,600	1,127,000
準備預金残	1,025,800	1,025,100	1,018,800	1,014,900	997,500	1,016,300
レート	0.071%	0.079%	0.086%	0.079%	0.073%	0.080%
月中平均	0.07422%	0.07447%	0.07505%	0.07557%	0.07546%	0.07564%