

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/2/26(水)

<<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	26日需給速報		27日需給予想		28日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,500	▲ 1,800	▲ 1,300		
財政		800	▲ 6,500	2,100		
資金過不足		▲ 700	▲ 8,300	800		
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						
国庫短期証売却						
国債買入		9,100		5,800		
CP等買入		▲ 200	▲ 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						
ETF買入						
国債補完供給						
小計		8,900	3,200	5,800		
当預増減		8,200	▲ 5,100	6,600		

当座預金残高	1,135,200	2/26以降の残り所要積立額	89,500
準備預金残高	1,018,100	2/27以降の残り所要積立額	73,800
積み終了先	870,400	積数	4,300
超過準備	869,400	1日平均	1,689,600
非準備先残高	117,100		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)			
準備預金進捗率	95.63% (実績)	39.29% (日数)	

2/25のマナターベース		2,029,800	
2/25コール	合計 167,491	無担 62,051	有担 105,440
コール前日増減	計 3,357	無担 1,720	有担 1,637

2/26の加重平均レート(速報)				2/25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
0.055 ~0.145 (0.079)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.050 ~0.145 (0.080)			
0.065 ~0.120 (0.084)					0.067 ~0.125 (0.090)		
					0.150 (0.150)		
0.115 ~0.130 (0.119)					0.200 (0.200)		
0.118 ~0.170 (0.144)					0.330 (0.330)		
0.118 (0.118)							
0.118 (0.118)		0.08-0.13	0.038-0.055			0.100 ~0.147 (0.125)	有担先日付分
		0.08-0.13	0.045-0.05				
		0.08-0.13	0.04-0.0425				
		-	-				
		-	0.0420				

## <<オペ情報、入札結果>>

国債補完	532億円	2/26	~ 2/27 (1日間)	応札 1億円	落札 1億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	2/28		応札 12,341億円	落札 4,006億円	按分利回り較差 0.003%	99.3%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	1,800億円	2/28		応札 6,416億円	落札 1,803億円	按分利回り較差 0.008%	48.7%	平均利回り較差	0.012%
ETF買入	123億円	約定日	2/26						

<< 2/27の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,130,100	前日比	▲ 5,100
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。

<< 26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1兆4,000億円増加の89兆4,000億円(当座預金残高見込は113兆5,000億円)。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。また、試し取りと思われる動きがみられ、0.12%近辺での出合いも一部見られた。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、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。

<< 26日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは若干低下し、0.065~0.07%程度。短国アウトライト市場は1M:0.038~0.055%、2M:0.045~0.05%、3M:0.04~0.0425%、1Y:0.042%の出合い。朝方から買いが目立ち、徐々に出合いレートを切り下げる展開。CP市場は、月末受渡にあたり、発行総額は1兆円程度に膨らんだ。期内償還物は大型発行案件が多く、若干レートが上昇。一方、期末を跨ぐものについては玉確保のニーズも強く、レートは横ばい圏となった。

<< 27日の材料 >>  
 \*佐藤日銀審議委員、国際銀行協会にて講演  
 \*米国1月の耐久財新規受注  
 \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、3/3発行)  
 \*2年利付国債入札(29,000億円、3/17発行)  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、3/7借入)

JGB新発10年債	0.585	0.000	日経平均株価(終値)	14,970.97	▲ 80.63	為替(9時)	102.16-17
						為替(5時)	102.33-34

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	2/19	2/20	2/21	2/24	2/25	2/26
日銀当預残	1,138,100	1,132,600	1,120,600	1,098,600	1,127,000	1,135,200
準備預金残	1,025,100	1,018,800	1,014,900	997,500	1,016,300	1,018,100
レート	0.079%	0.086%	0.079%	0.073%	0.080%	0.079%
月中平均	0.07447%	0.07505%	0.07557%	0.07546%	0.07564%	0.07577%

「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