

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/3/10(月) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想		12日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,000		800		1,000
財政		▲ 33,900		1,300		▲ 4,000
資金過不足		▲ 32,900		2,100		▲ 3,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		3,400				
160,557		▲ 3,200				
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入				20,000		
国庫短期証売却						
国債買入				3,200		9,000
CP等買入		4,400				
		▲ 900		▲ 400		
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 50,859						
被災地支援						
3,805						
社債等買入				▲ 200		
ETF買入				100		
国債補完供給						
小計		3,700		22,700		9,000
当預増減		▲ 29,200		24,800		6,000

当座預金残高	1,101,800	3/10以降の残り所要積立額	13,100
準備預金残高	986,200	3/11以降の残り所要積立額	9,200
積み終了先	862,000	積数	1,800
超過準備	862,000	1日平均	1,800
非準預先残高	115,600		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,686,700		
準備預金進捗率	99.45% (実績)	82.14% (日数)	

3/7のマナリーベース		2,036,900	
3/7コール 合計	171,549 無担	65,936 有担	105,613
コール前日増減 計	4,146 無担	513 有担	3,633

3/10の加重平均レート(速報)				3/7の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.055 ~0.145 (0.075)	0.040 ~0.050 (0.041)	CP気配a-1	短国	O/N	0.060 ~0.145 (0.073)		
0.071 ~0.125 (0.088)				T/N		0.100 ~0.120 (0.100)	
				S/N		0.100 (0.100)	
0.117 ~0.400 (0.142)				1W		0.116 ~0.117 (0.116)	
0.330 (0.330)				2W		0.078 (0.078)	
				3W		0.118 (0.118)	
		0.08-0.13	-	1M		0.077 (0.077)	有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.023-0.025	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

社債買入	1,000億円	3/14	応札	2,005億円	落札	978億円	按分レート	0.101%	70.3%	平均落札レート	0.130%
国債買入	2,500億円	3/12	応札	10,668億円	落札	2,500億円	按分利回り較差	0.003%	99.2%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,500億円	3/12	応札	13,262億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	0.001%	76.7%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	4,000億円	3/12	応札	12,190億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	-0.008%	6.6%	平均利回り較差	-0.005%
ETF買入	118億円	約定日	3/10								
J-REIT買入	3億円	約定日	3/10								

「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

<< 3/11の日銀調節とレート予想 >>

日銀調節	見送り	当座預金残高	1,126,600	前日比	24,800
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。

<< 10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2兆6,000億円減少の87兆2,000億円(当座預金残高見込は110兆3,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは0.071%の出合いで、大手行から0.06%、地銀・信託・証券業態から0.07%前後の調達希望で始まった。一巡後は調達側が薄くなる中、同水準で出合いが散見されつつ、本日の取引を終了した。T/Nは0.07%前後の出合いがみられた。ターム物に関してはロールオーバーの案件が中心となった。

<< 10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、動意薄く、全般的に閑散。3M近辺で0.020%売り/0.025%買いの気配で終始推移し、出合いは3M 0.023~0.025%で少額見られた程度であった。CP市場は、償還総額500億円強に対し、電機・石油・繊維業態よりまとまった額の発行があったことから、発行総額は1,500億円強と大きく上回った。運用ニーズは引き続き堅調で、利回り水準は小幅低下となった。

<< 11日の材料 >>

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- *黒田日銀総裁、定例会見
- *1月の特定サービス産業動態統計速報 *2月のマネーストック
- *米国1月の卸売売上高

JGB新発10年債	0.625	0.000	日経平均株価(終値)	15,120.14	▲ 153.93	為替(9時)	103.17-18
						為替(5時)	103.10-11

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	3/3	3/4	3/5	3/6	3/7	3/10
日銀当預残	1,119,000	1,109,900	1,110,800	1,112,100	1,131,000	1,101,800
準備預金残	1,005,500	996,300	996,500	997,900	1,019,100	986,200
レート	0.074%	0.074%	0.078%	0.075%	0.073%	0.075%
月中平均	0.07267%	0.07300%	0.07400%	0.07417%	0.07378%	0.07390%

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