

2014/3/12(水)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	12日需給速報		13日需給予想	14日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		500	▲ 200	▲ 1,000
財政		▲ 2,300	700	1,000
資金過不足		▲ 1,800	500	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
160,557				
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		9,200		
CP等買入				
		▲ 300	▲ 200	
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				1,000
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		8,900	▲ 100	1,000
当預増減		7,100	400	1,000

当座預金残高	1,133,500	3/12以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,019,100		6,500
積み終了先	899,200	3/13以降の残り所要積立額	
超過準備	899,200	積数	4,100
非準備先残高	114,400	1日平均	1,400
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	99.76% (実績)	89.29% (日数)	

3/11のマネタリーベース		2,030,500	
3/11コール 合計	173,137	無担	70,974
コール前日増減	計	▲ 1,416	無担
		2,373	有担
			▲ 3,789

3/12 の加重平均レート(速報)					3/11 の加重平均レート(確報)					単位 (%)	
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		
0.055 ~0.145 (0.075)	0.040 ~0.050 (0.041)				O/N	0.050 ~0.145 (0.075)			0.040 ~0.050 (0.041)		
0.070 ~0.125 (0.080)					T/N		0.070 ~0.121 (0.083)				
					S/N		0.130 (0.130)				
0.130 (0.130)					1W		0.075 ~0.200 (0.123)				
0.118 (0.118)					2W		0.118 ~0.330 (0.128)				
					3W						
			0.08-0.13	-	1M		0.117 (0.117)		有担先日付分		
			0.08-0.13	-	2M						
			0.08-0.13	0.025-0.028	3M						
			-	0.0200	6M						
			-	-	1Y						

《オペ情報、入札結果》

流動性供給 応札 9,050億円 落札 2,996億円 3/14 按分利回較差 0.004% 按分 54.4642% 平均利回較差▲0.001%

ETF買入 118億円 約定日 3/12

J-REIT買入 3億円 約定日 3/12

「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

《 3/13の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,133,900	前日比	400
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。					

《 12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9,000億円増加の90兆1,000億円(当座預金残高見込は113兆3,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは0.073%の出合いで、大手行から0.06%、地銀・信託・証券業態から0.07%前後の調達希望が始まった。一巡後は調達側が薄くなる中、0.07%近辺で推移し、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。ターム物は、証券業態のロール案件が中心の取引となった。

《 12日のオープン市場動向 》

現先レートは、低位横ばい圏で推移。短国市場は、午前中に既発債の6月償還物で0.025%が散発的に出合った。午後には明日入札となる3M物のW I取引で0.027%と0.028%で大きく出合いがみられ、入札レートを探る展開となった。その他では、4月償還物で0.02%の出合いが見られた。CP市場は、償還総額3,900億円弱に対し、幅広い業態で発行案件がみられたものの、発行総額2,200億円強と大きく下回った。レート水準は、概ね横ばい圏ながらも、レートが下がる銘柄も散見された。

《 13日の材料 》

*1月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+7.0%)

*1月のマネタリーサーベイ

*米国1月の企業在庫 *米国2月の小売売上高

*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、3/17発行)

JGB新発10年債	0.625	0.000	日経平均株価(終値)	14,830.39	▲ 393.72	為替(9時)	102.84-85
						為替(5時)	102.87-89

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	3/5	3/6	3/7	3/10	3/11	3/12
日銀当預残	1,110,800	1,112,100	1,131,000	1,101,800	1,126,400	1,133,500
準備預金残	996,500	997,900	1,019,100	987,500	1,009,900	1,019,100
レート	0.078%	0.075%	0.073%	0.075%	0.075%	0.075%
月中平均	0.07400%	0.07417%	0.07378%	0.07390%	0.07400%	0.07408%