

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/3/20(木)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	20日需給速報		24日需給予想	25日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,700	100	0
財政		53,900	▲ 12,400	17,000
資金過不足		51,200	▲ 12,300	17,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,700	
153,740			▲ 8,000	
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		15,100	2,100	9,000
CP等買入		4,100		
		▲ 700	▲ 600	
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512				
被災地支援				
3,805				
社債等買入		▲ 300		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		18,200	▲ 4,800	9,000
当預増減		69,400	▲ 17,100	26,000

当座預金残高	1,235,800	3/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,122,800		301,000
積み終了先	923,300	3/24以降の残り所要積立額	
超過準備	906,600	積数	148,200
非準預先残高	113,000	1日平均	6,400
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,870,000		
準備預金進捗率	92.07% (実績)	25.81% (日数)	

3/19のマネタリーベース		2,071,800	
3/19コール 合計	174,264	無担	69,387 有担 104,877
コール前日増減	計	▲ 668	無担 121 有担 ▲ 789

3/20 の加重平均レート(速報)					3/19 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	有担当当日分	有担当先日付分	
0.055 ~0.150 (0.072)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N	0.050 ~0.145 (0.077)		0.040 ~0.050 (0.041)		
0.065 ~0.120 (0.075)				T/N		0.073 ~0.120 (0.088)			
				S/N					
0.075 ~0.117 (0.116)				1W		0.101 ~0.150 (0.116)			
				2W					
				3W					
		0.08-0.13	-	1M		0.300 (0.300)	有担当先日付分		
		0.08-0.13	0.0325-0.039	2M					
		0.08-0.13	0.0175-0.02	3M					
		-	-	6M					
		-	-	1Y					

《オペ情報、入札結果》

国債買入	2,500億円	3/25	応札	10,620億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	0.006%	93.6%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	2,500億円	3/25	応札	14,237億円	落札	2,505億円	按分利回り較差	0.003%	35.4%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	4,000億円	3/25	応札	13,981億円	落札	4,010億円	按分利回り較差	-0.002%	33.3%	平均利回り較差	0.000%
T-Bill2M	応札16兆6,022億円	落札2兆3,176億6,000万円(非競争入札:1,823億円)	3/25~5/23	0.0371%	按分17.8094%	平均0.0346%					
ETF買入	118億円	約定日	3/20								

《 3/24の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,218,700	前日比	▲ 17,100
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。					

《 20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2兆1,000億円増加の94兆4,000億円(当預金残高見込は123兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06~0.065%、地銀・信託・証券業態などから0.07%前後での調達希望。立ち上がりは0.07%前後の出合い。資金余剰の影響から一巡後の調達意欲は低調で、0.065%までレートが下がる場面も見られた。ターム物では、1Wの期間で大手行によるまとまった調達が確認された。

《 20日のオープン市場動向 》

現先レートは、レボレート上昇の影響から短国・CP市場共に小高く推移。短国市場では、2M物入札(440回)が実施された。WI取引では0.039%でトレードがみられていたものの、落札結果は平均落札利回0.0346%、按分落札利回0.0371%と市場実勢通りの結果となった。セカンダリーは、ショートカバーから一時0.0325%まで買い進まれるも、ラストは0.038%で出合うなど小甘く推移。CP市場では、25日発行に当たるも発行総額は1,500億円程度(同償還総額3,000億円程度)にとどまった。発行レートは、横ばいから小幅低下方向での決着が目立った。

《 24日の材料 》

*岩田日銀副総裁、国際東アジア研究センターにて講演

《コール2月積み期間分の加重平均レート》

(土日を含む)	無担	0.07507%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07555%	有担	0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.43-45
0.595 ▲ 0.010	14,224.23 ▲ 238.29	為替(5時)	102.36-38

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	3/13	3/14	3/17	3/18	3/19	3/20
日銀当預残	1,133,100	1,138,000	1,099,200	1,160,300	1,166,400	1,235,800
準備預金残	1,019,100	1,031,100	993,500	1,049,800	1,052,600	1,122,800
レート	0.073%	0.072%	0.074%	0.080%	0.077%	0.072%
月中平均	0.07400%	0.07363%	0.07365%	0.07400%	0.07416%	0.07405%

「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