

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/3/25(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		▲ 300	▲ 1,100	▲ 1,000
財政		19,800	11,200	▲ 1,000
資金過不足		19,500	10,100	▲ 2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
147,384				
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		9,200		
CP等買入		▲ 1,000	▲ 300	
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				
ETF買入		100	100	
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		8,200	19,900	0
当預増減		27,700	30,000	▲ 2,000

当座預金残高	1,244,900	3/25以降の残り所要積立額	125,900
準備預金残高	1,127,400	3/26以降の残り所要積立額	99,900
積み終了先	927,000	積数	4,800
超過準備	920,800	1日平均	4,800
非準備先残高	117,500		
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	94.66% (実績)	32.26% (日数)	

3/24のマネタリーベース		2,125,100	
3/24コール	合計	184,892	無担 68,949 有担 115,943
コール前日増減	計	5,310	無担 ▲ 463 有担 5,773

3/25の加重平均レート(速報)				3/24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	
0.020 ~0.085 (0.069)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.045 ~0.145 (0.073)			
0.065 ~0.120 (0.075)					0.070 ~0.120 (0.076)		
					0.275 (0.275)		
					0.220 (0.220)		
0.310 ~0.330 (0.312)							
0.100 (0.100)		0.08-0.13	0.0250		0.210 (0.210)		有担先日付分
		0.08-0.13	0.025-0.035				
		0.08-0.13	0.019-0.020				
		-	-				
		-	0.0260				

3/26の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,274,900	前日比	30,000
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。

《 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2兆2,000億円増加の95兆1,000億円(当預金残高見込は124兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06~0.065%、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。一日を通して調達意欲は限定的で、一巡以降は0.065~0.07%の出合いを中心に推移した。ターム物は、証券業態によるロール案件の調達が中心となった。

《 25日のオープン市場動向 》  
 現先S/N物は低位横ばい圏で推移。短国市場は明日の3M物入札を控えて様子見姿勢が強まる中、アウトライト市場は2M0.025~0.035%、3M0.019~0.020%で出合うなど全般的に堅調。CP市場は償還総額3,700億円程度に対し、機械業態からまとまった発行案件が一部で見られたものの、発行総額は900億円程度と閑散。発行レートは概ね横ばい圏での動き。

《 26日の材料 》  
 \*2月の企業向けサービス価格指数  
 \*米国2月の耐久財新規受注  
 \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、3/28発行)

JGB新発10年債	0.605	0.000	日経平均株価(終値)	14,423.19	▲ 52.11	為替(9時)	102.23-24
						為替(5時)	102.13-14

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	3/17	3/18	3/19	3/20	3/24	3/25
日銀当預残	1,099,200	1,160,300	1,166,400	1,235,800	1,217,200	1,244,900
準備預金残	993,500	1,049,800	1,052,600	1,122,900	1,106,300	1,127,400
レート	0.074%	0.080%	0.077%	0.072%	0.073%	0.069%
月中平均	0.07365%	0.07400%	0.07416%	0.07378%	0.07375%	0.07356%

## 《オペ情報、入札結果》

国債補完 6,000億円 3/25 ~ 3/26 (1日間) 応札 91億円 落札 91億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)  
 米ドル資金供給(固定金利方式) 3/27 ~ 4/3 (7日間) 応札なし 貸付利率0.580%  
 流動性供給 応札1兆92億円 2,989億円 3/27 募入最大利回較差▲0.003% 按分47.4153% 募入平均利回較差▲0.007%

「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