

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/3/28(金) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	28日需給速報		31日需給予想		1日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,700	800	1,000		
財政		3,500	11,800	▲ 12,000		
資金過不足		1,800	12,600	▲ 11,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			1,000			
147,384			▲ 6,900			
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入					10,000	
国庫短期証売却						
国債買入		9,000			6,700	
CP等買入			4,400			
		▲ 500	▲ 7,400			
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				
国債補完供給	即日	200				
		▲ 300	300			
小計		8,500	▲ 8,600	16,700		
当預増減		10,300	4,000	5,700		

<< 3/31の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,286,000	前日比	4,000
O/N	0.02~0.075	T/N	0.02~0.08	S/N	0.03~0.08

無担O/Nは0.03~0.05%を中心とした比較的広いレンジでの出合いで推移しよう。

<< 28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1兆6,000億円増加の99兆2,000億円(当預金残高見込は128兆3,000億円)。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0.065~0.07%前後の出合い。調達需要は弱く、一巡後は0.06~0.065%の出合いを中心に推移した。末初物のT/Nでは調達ニーズはほとんど見られず、0.02~0.03%の出合いが中心となった。ターム物は、動意に乏しく閑散な地合いとなった。

<< 28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。短国市場は短国買入オペが1兆円に減額され実施された。平均利回較差+0.005%、按分利回較差+0.002%と受渡し日が期末を越えた事もあり、やや調整売りが入る動きとなった。CP市場は償還額300億円程度に対し、鉄鋼・鉄鋼・食品業態からのまとまった発行案件が見られたことで発行額は2,500億円程度に膨らんだ。発行レートは投資家の運用ニーズが強く、低位横ばい圏で推移。

<< 31日の材料 >>
 *2月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.3%)
 *2月の住宅着工統計
 *米国3月のシカゴPM景況感指数
 *ユーロ圏3月の消費者物価指数速報値

当座預金残高	1,282,000	3/28以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,172,000		66,000
積み終了先	984,700	3/31以降の残り所要積立額	
超過準備	981,700	積数	41,300
非準預先残高	110,000	1日平均	2,600
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	97.79% (実績)	48.39% (日数)	

JGB新発10年債	0.630	0.000	日経平均株価(終値)	14,696.03	73.14	為替(9時)	102.16-17
						為替(5時)	102.16-17

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	3/20	3/24	3/25	3/26	3/27	3/28
日銀当預残	1,235,800	1,217,200	1,244,900	1,276,000	1,271,700	1,282,000
準備預金残	1,122,900	1,106,300	1,127,600	1,161,900	1,162,900	1,172,000
レート	0.072%	0.073%	0.069%	0.070%	0.070%	0.069%
月中平均	0.07378%	0.07375%	0.07356%	0.07342%	0.07330%	0.07287%

3/27のマネタリーベース			
		2,183,400	
3/27コール	合計	166,688	無担 56,258 有担 110,430
コール前日増減	計	▲ 7,212	無担 ▲ 3,274 有担 ▲ 3,938

3/28の加重平均レート(速報)				3/27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		O/N	
0.030	~0.145 (0.069)	0.040	~0.050 (0.041)					0.060	~0.121 (0.070)
0.020	~0.121 (0.027)								0.065 ~0.121 (0.080)
0.030	(0.030)								0.030 (0.030)
0.085	~0.400 (0.129)								0.088 ~0.117 (0.091)
0.118	~0.185 (0.140)								0.118 (0.118)
0.118	(0.118)			0.08-0.13	0.0250	1M		0.118	(0.118)
				0.08-0.13	-	2M			有担先日付分
0.125	(0.125)			0.08-0.13	0.020-0.035	3M		0.125	(0.125)
				-	0.020-0.030	6M			
				-	0.0300	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	3/28	~ 3/31 (3日間)	応札	263億円	落札	263億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	10,000億円	4/1		応札	28,734億円	落札	10,001億円	0.002%	61.3%	平均	0.005%
国債買入	2,500億円	4/1		応札	12,689億円	落札	2,500億円	0.008%		平均	0.008%
国債買入	2,500億円	4/1		応札	11,702億円	落札	2,504億円	-0.003%	55.0%	平均	-0.003%
国債買入	1,700億円	4/1		応札	6,461億円	落札	1,702億円	-0.006%	40.2%	平均	-0.005%

J-REIT買入 3億円 約定日 3/28

「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