

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/2/25(水)

《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	金額	金額
銀行券		▲ 1,400	▲ 2,100	▲ 1,600		
財政		3,100	▲ 3,300	5,400		
資金過不足		1,700	▲ 5,400	3,800		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
65,630						
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		5,500		11,800		
CP等買入				4,000		
		▲ 400	▲ 600			
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789						
被災地支援						
3,252						
社債等買入		▲ 300				
ETF買入		100				
国債補充供給						
小計		4,900	▲ 600	15,800		
当増減		6,600	▲ 6,000	19,600		

《 2/26の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,831,400	前日比	▲ 6,000
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.07%台前半での出合いが中心となると見込まれる。

### 《 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みは、137兆5,000億円(当座預金残高見込みは183兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.074%、都銀からは0.07%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.074%と昨日よりもやや強めの地合いとなった。一巡後は、ビッドが薄くなり、0.07%近辺での出合いが散見される程度で取引を終えた。本日も一部業態が試し取りを行ったため、加重平均が上昇した。ターム物に関しては、目立った出合いは見られず、本日もロール案件での出合いが散見される程度であった。

### 《 25日のオープン市場動向 》

現先S/N物は横ばい圏で推移した。引き続き一部の銘柄が強含んだ以外は、明日の入札を控え小動きであった。CP市場は償還総額13,000億円程度に対し、発行総額は月末発行ということもあって幅広い業態からの発行案件が見られたものの、9,000億円程度にとどまった。発行レートは小幅に上昇する展開となった。

### 《 26日の材料 》

- \*石田日銀審議委員、神奈川県金融経済懇談会にて講演
- \*米国1月の消費者物価指数 \*米国1月の耐久財新規受注
- \*国庫短期証券入札(3ヵ月、57,000億円、3/2発行)
- \*2年利付国債入札(27,000億円、3/16発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、3/6借入)

当座預金残高	1,837,400	2/25以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,666,500		42,300
積み終了先	1,361,700	2/26以降の残り所要積立額	
超過準備	1,360,500	積数	33,800
非準備先残高	170,900	1日平均	1,900
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,776,900		
準備預金進捗率	98.10% (実績)	35.71% (日数)	

JGB新発10年債	0.335	▲ 0.040	日経平均株価(終値)	18,585.20	▲ 18.28	為替(9時)	118.86-88
						為替(5時)	118.82-84

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	2/18	2/19	2/20	2/23	2/24	2/25
日銀当預残	1,843,100	1,829,300	1,810,400	1,791,100	1,830,800	1,837,400
準備預金残	1,682,500	1,659,000	1,646,000	1,628,900	1,669,200	1,666,500
レート	0.077%	0.082%	0.075%	0.078%	0.077%	0.086%
月中平均	0.07433%	0.07474%	0.07477%	0.07491%	0.07500%	0.07544%

2/24のマネタリーベース				2,765,100		
2/24コール	合計	202,186	無担	75,405	有担	126,781
コール前日増減	計	▲ 1,308	無担	▲ 205	有担	▲ 1,103

2/25の加重平均レート(速報)				2/24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		有担当日分	
0.030 ~0.130 (0.086)	0.030	~0.040	(0.031)			0.050 ~0.130 (0.077)		0.030	~0.040 (0.031)
0.074 ~0.125 (0.083)							0.050 ~0.120 (0.081)		
0.105 ~0.117 (0.109)							0.117 (0.117)		
0.110 ~0.118 (0.112)							0.310 (0.310)		
0.144 (0.144)				0.08-0.12	-	1M	0.145 (0.145)		有担先日付分
				0.08-0.12	0.0000	2M			
				0.08-0.12	▲0.01-▲0.007	3M			
				-	-	6M			
				-	▲0.013-▲0.01	1Y			

## 《オペ情報、入札結果》

国債買入	4,000億円	2/27	応札	9,872億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	-0.010%	11.9%	平均利回り較差	-0.008%
国債買入	4,000億円	2/27	応札	14,186億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.004%	34.9%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	2,400億円	2/27	応札	4,463億円	落札	2,402億円	按分利回り較差	-0.025%	50.7%	平均利回り較差	-0.017%
国債買入	1,400億円	2/27	応札	3,618億円	落札	1,405億円	全取利回り較差	-0.014%		平均利回り較差	-0.008%
J-REIT買入	12億円	約定日	2/25								

「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録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