

2015/3/19(木) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	19日需給速報 即日 金額	20日需給予想 金額	23日当社予想 金額
銀行券	▲ 1,200	▲ 1,000	1,000
財政	4,000	13,200	▲ 6,000
資金過不足	2,800	12,200	▲ 5,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)		7,600	1,100
65,430		▲ 5,700	▲ 1,000
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		10,600	7,800
CP等買入			5,000
	▲ 200	▲ 700	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470			
被災地支援			
3,252			
社債等買入	▲ 100	▲ 300	
ETF買入	100		
国債補完供給			
小計	▲ 200	11,500	12,900
当預増減	2,600	23,700	7,900

当座預金残高	1,890,200	3/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,715,500		242,400
積み終了先	1,371,000	3/20以降の残り所要積立額	
超過準備	1,367,300	積数	186,500
非準預先残高	174,700	1日平均	6,900
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,971,500		
準備預金進捗率	90.54%	(実績)	12.90% (日数)

3/18のマネタリーベース	2,822,900
3/18コール合計	220,146 無担 91,943 有担 128,203
コール前日増減	計 551 無担 1,754 有担 ▲ 1,203

3/19 の加重平均レート(速報)				3/18 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			
0.060 ~0.130 (0.071)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.020 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)			
0.068 ~0.120 (0.077)				T/N	0.075 ~0.130 (0.104)				
				S/N					
0.065 ~0.117 (0.111)				1W	0.117 (0.117)				
0.117 (0.117)				2W	0.077 (0.077)				
				3W					
		0.08-0.13	-	1M					有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12	▲0.002-0.008	3M					
		-	-	6M					
		-	▲0.001	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	3/23	~ 6/22 (91日間)	応札	1,091億円	落札	1,091億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	4,000億円	3/23	応札	7,072億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	-0.047%	69.9%	平均利回り較差	-0.039%
国債買入	2,400億円	3/23	応札	5,194億円	落札	2,401億円	按分利回り較差	-0.080%	12.7%	平均利回り較差	-0.064%
国債買入	1,400億円	3/23	応札	4,101億円	落札	1,402億円	按分利回り較差	-0.120%	98.8%	平均利回り較差	-0.099%
T-Bill3M	応札20兆9,788億円	落札5兆3,668億8,000万円(非競争入札:3,531億円)	3/23~6/22	0.0080%	按分67.8333%	平均0.0020%					
ETF買入	352億円	約定日 3/19									

「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

<< 3/20の日銀調節とレート予想 >>

日銀調節	見送り	当座預金残高	1,913,900	前日比	23,700
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%前後の出合いが中心になると見込まれる。

<< 19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、前日比6,000億円減の143兆1,000億円(当座預金残高見込みは過去最高の189兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.075%での調達が始まった。その後は急速にビッド水準が低下し、0.06%台後半を中心に散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W物0.117%での調達が見られた。

<< 19日のオープン市場動向 >>

短国現先レートは上昇。短国3M物の入札は平均落札利回り0.002%、按分落札利回り0.008%と、平均こそ事前予想通りでの決着となったが、慎重姿勢の強まりからか按分は流れる小甘い結果となった。セカンダリーでは、在庫調整からか0.007~0.008%での出合いが見られた。その他1Y物で▲0.001%での出合いが見られた。CP市場は、償還総額1,300億円程度に対し、小売業態からの大型発行案件が見られたものの発行総額は700億円程度にとどまった。発行レートは一部銘柄が小幅に低下する展開となった。

<< 20日の材料 >>

*黒田日銀総裁、日本外国特派員協会にて講演

*日銀金融政策決定会合議事要旨(2月17、18日開催分)

<<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	0.07650%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07720%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.06-08
0.325 ▲ 0.040	19,476.56 ▲ 67.92	為替(5時)	120.61-63

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	3/12	3/13	3/16	3/17	3/18	3/19
日銀当預残	1,833,800	1,841,400	1,834,300	1,852,500	1,887,600	1,890,200
準備預金残	1,673,000	1,679,400	1,677,800	1,691,700	1,728,100	1,715,500
レート	0.076%	0.075%	0.075%	0.075%	0.075%	0.071%
月中平均	0.07625%	0.07600%	0.07594%	0.07588%	0.07583%	0.07558%