

2015/3/24(火)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	24日需給速報	25日需給予想	26日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 1,100	▲ 1,000	▲ 1,000
財政	3,600	22,100	3,000
資金過不足	2,500	21,100	2,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)	3,900		
67,517	▲ 3,800		
国債買現			
0			
CP買現			
0			
国庫短期証買入	15,000		
国庫短期証売却			
国債買入		10,700	
CP等買入			
	▲ 300	▲ 1,800	
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	
ETF買入	100	100	
国債補完供給	即日 ▲ 100	500	
小計	14,800	9,400	0
当預増減	17,300	30,500	2,000

当座預金残高	1,938,400	3/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,780,000		66,100
積み終了先	1,446,500	3/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,439,300	積数	52,200
非準備先残高	158,400	1日平均	2,400
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	97.35% (実績)	29.03% (日数)	

3/23のマネタリーベース	2,858,900
3/23コール 合計	203,090 無担 72,433 有担 130,657
コール前日増減 計	6,030 無担 5,763 有担 267

3/24 の加重平均レート(速報)				3/23 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	有担先日付分	
0.055 ~0.130 (0.064)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.130 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.061 ~0.120 (0.068)				T/N	0.063 ~0.120 (0.074)			
				S/N				
0.065 (0.065)				1W	0.117 (0.117)			
				2W				
				3W				
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.0080	3M				
		-	▲0.015	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完	16,000億円	3/24 ~ 3/25 (1日間)	応札	334億円	落札	334億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債補完	8,000億円	3/24 ~ 3/25 (1日間)	応札	121億円	落札	121億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
米ドル資金供給(固定金利方式)	3/26 ~ 4/2 (7日間)	応札	8億1,000万ドル	落札	8億1,000万ドル	貸付利率	0.610%			
流動性供給	応札 1兆2,430億円	落札 3,991億円	3/26 募入最大利回較差	-0.003 %	按分	42.9416 %	募入平均利回較差	-0.008 %		
ETF買入	352億円	約定日	3/24							

「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

《 3/25の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,968,900	前日比	30,500
O/N	0.055~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12
無担O/Nは0.06~0.065%程度の出合いが中心になると見込まれる。					

《 24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1兆3,000億円増の145兆8,000億円(当座預金残高見込みは過去最高の193兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.06~0.065%での調達で始まった。一巡後は、0.06%前後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、大手行の調達も無く、ロール案件中心の取引となった。

《 24日のオープン市場動向 》

短国現先レートは若干の低下となった。短国市場は動意に乏しく、閑散とした中、3M物で0.008%、6M物で▲0.015%の出合いが散見された程度であった。CP市場は石油業態でまとまった発行が見られたものの発行案件が少なく、発行総額は800億円弱にとどまった。発行レートは業種を問わず落ちついた水準となった。

《 25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

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	119.75-77
0.305 ▲ 0.005	19,713.45 ▲ 40.91	為替(5時)	119.60-62

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	3/23	3/24
日銀当預残	1,852,500	1,887,600	1,890,200	1,912,700	1,921,100	1,938,400
準備預金残	1,691,700	1,728,100	1,716,400	1,760,300	1,764,100	1,780,000
レート	0.075%	0.075%	0.071%	0.066%	0.065%	0.064%
月中平均	0.07588%	0.07583%	0.07558%	0.07427%	0.07387%	0.07346%