

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/3/25(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 |
| 銀行券 | | ▲ 1,000 | ▲ 1,800 | ▲ 1,000 |
| 財政 | | 22,000 | 1,500 | ▲ 4,000 |
| 資金過不足 | | 21,000 | ▲ 300 | ▲ 5,000 |
| 貸出 | | | | |
| 売出手形 | | | | |
| 0 | | | | |
| 本店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 全店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 共通(固定) | | | | |
| 67,517 | | | | |
| 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 | | 10,700 | | 10,500 |
| CP等買入 | | | | |
| | | ▲ 1,800 | ▲ 500 | |
| 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 | | |
| 国債補完供給 | 即日 | ▲ 100 | | |
| | | 500 | 100 | |
| 小計 | | 9,300 | ▲ 400 | 10,500 |
| 当増減 | | 30,300 | ▲ 700 | 5,500 |

| | | | |
|---------------------------|-----------|----------------|-------------|
| 当座預金残高 | 1,968,700 | 3/25以降の残り所要積立額 | |
| 準備預金残高 | 1,808,600 | | 52,200 |
| 積み終了先 | 1,473,100 | 3/26以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 1,472,100 | 積数 | 43,000 |
| 非準預先残高 | 160,100 | 1日平均 | 2,000 |
| 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 | 97.82% | (実績) | 32.26% (日数) |

| 3/24のマネタリーベース | | 2,877,200 | |
|---------------|----|-----------|----------------------|
| 3/24コール | 合計 | 202,329 | 無担 73,640 有担 128,689 |
| コール前日増減 | 計 | ▲ 761 | 無担 1,207 有担 ▲ 1,968 |

| 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 | | 無担先日付分 | |
| 0.055 ~ 0.130 (0.065) | 0.030 ~ 0.040 (0.031) | | | 0.055 ~ 0.130 (0.064) | | | 0.030 ~ 0.040 (0.031) |
| 0.063 ~ 0.130 (0.075) | | | | | 0.061 ~ 0.120 (0.068) | | |
| 0.075 (0.075) | | | | | | | |
| | | | | 1W 0.065 (0.065) | | | |
| | | | | 2W | | | |
| | | | | 3W | | | |
| 0.185 (0.185) | | 0.08-0.13 | - | 1M | | | 有担先日付分 |
| | | 0.08-0.12 | - | 2M | | | |
| | | 0.08-0.12 | - | 3M | | | |
| | | - | - | 6M | | | |
| | | - | ▲ 0.015 | 1Y | | | |

◀ オペ情報、入札結果 ▶

| | | | | | | | | | | | | |
|------|---------|------|----|------------|----|---------|---------|--------|---------|---------|--------|-------------|
| 国債補完 | 4,000億円 | 3/25 | ~ | 3/26 (1日間) | 応札 | 30億円 | 落札 | 30億円 | -0.400% | 全取 | 平均 | -0.400% (即) |
| 国債補完 | 4,000億円 | 3/25 | ~ | 3/26 (1日間) | 応札 | 50億円 | 落札 | 50億円 | -0.400% | 全取 | 平均 | -0.400% (即) |
| 国債買入 | 3,000億円 | 3/27 | 応札 | 9,062億円 | 落札 | 3,003億円 | 按分利回り較差 | 0.003% | 84.7% | 平均利回り較差 | 0.005% | |
| 国債買入 | 3,500億円 | 3/27 | 応札 | 12,699億円 | 落札 | 3,503億円 | 按分利回り較差 | 0.003% | 33.6% | 平均利回り較差 | 0.005% | |
| 国債買入 | 4,000億円 | 3/27 | 応札 | 13,318億円 | 落札 | 4,006億円 | 按分利回り較差 | 0.002% | 4.5% | 平均利回り較差 | 0.003% | |

「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。」

| ◀ 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 | 1,968,000 | 前日比 | ▲ 700 |
| 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%台前半の出合いが中心になると見込まれる。

◀ 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、前日比2兆1,000億円増の147兆9,000億円(当座預金残高見込みは過去最高の196兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.061~0.065%中心での調達で始まった。一巡後は、0.06%前後を中心に散發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。

◀ 25日のオープン市場動向 ▶

現先レートは横ばい圏での推移となった。短国市場は全般的に閑散な中、1Yで▲0.015%の出合いが見られた程度であった。CP市場は、ノンバンク等によるまとまった発行もあり、発行総額は1,750億円程度となった。発行レートは引続き落ち着いた水準で推移していた。

◀ 26日の材料 ▶

*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、3/30発行)
*2年利付国債入札(25,000億円、4/15発行)

| | | | | | | | |
|-----------|-------|-------|------------|-----------|-------|--------|-----------|
| JGB新発10年債 | 0.330 | 0.025 | 日経平均株価(終値) | 19,746.20 | 32.75 | 為替(9時) | 119.77-79 |
| | | | | | | 為替(5時) | 119.61-63 |

| 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 | 3/18 | 3/19 | 3/20 | 3/23 | 3/24 | 3/25 |
| 日銀当預残 | 1,887,600 | 1,890,200 | 1,912,700 | 1,921,100 | 1,938,400 | 1,968,700 |
| 準備預金残 | 1,728,100 | 1,716,400 | 1,760,300 | 1,764,100 | 1,781,600 | 1,808,600 |
| レート | 0.075% | 0.071% | 0.066% | 0.065% | 0.064% | 0.065% |
| 月中平均 | 0.07583% | 0.07558% | 0.07427% | 0.07387% | 0.07346% | 0.07312% |

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