

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2014/3/6(木) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

|             | 6日需給速報 |       | 7日需給予想  | 10日当社予想  |
|-------------|--------|-------|---------|----------|
|             | 即日     | 金額    | 金額      | 金額       |
| 銀行券         |        | 0     | ▲ 500   | 1,000    |
| 財政          |        | 1,600 | 11,500  | ▲ 26,000 |
| 資金過不足       |        | 1,600 | 11,000  | ▲ 25,000 |
| 貸出          |        |       |         |          |
| 売出手形        |        |       |         |          |
| 0           |        |       |         |          |
| 本店共通        |        |       |         |          |
| 0           |        |       |         |          |
| 全店共通        |        |       |         |          |
| 0           |        |       |         |          |
| 共通(固定)      |        |       |         | 3,400    |
| 160,417     |        |       |         | ▲ 3,200  |
| 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        |        |       | 9,400   |          |
| CP等買入       |        |       |         | 4,400    |
|             |        | ▲ 300 | ▲ 300   |          |
| 貸出支援基金      |        |       | 6,300   |          |
| (成長) 34,599 |        |       |         |          |
| (増加) 50,859 |        |       | ▲ 7,500 |          |
| 被災地支援       |        |       |         |          |
| 3,805       |        |       |         |          |
| 社債等買入       |        |       | ▲ 100   |          |
| ETF買入       |        |       | 100     |          |
| 国債補完供給      |        |       |         |          |
| 小計          |        | ▲ 300 | 7,900   | 4,600    |
| 当預増減        |        | 1,300 | 18,900  | ▲ 20,400 |

|                           |           |               |             |
|---------------------------|-----------|---------------|-------------|
| 当座預金残高                    | 1,112,100 | 3/6以降の残り所要積立額 |             |
| 準備預金残高                    | 997,900   |               | 27,600      |
| 積み終了先                     | 863,800   | 3/7以降の残り所要積立額 |             |
| 超過準備                      | 863,800   | 積数            | 23,100      |
| 非準備預先残高                   | 114,200   | 1日平均          | 2,600       |
| 積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数) | 1,684,600 |               |             |
| 準備預金進捗率                   | 98.63%    | (実績)          | 67.86% (日数) |

| 3/5のマネタリーベース |    | 2,016,200 |                      |
|--------------|----|-----------|----------------------|
| 3/5コール       | 合計 | 168,496   | 無担 66,490 有担 102,006 |
| コール前日増減      | 計  | 2,277     | 無担 4,425 有担 ▲ 2,148  |

| 3/6 の加重平均レート(速報)     |                      |           |             | 3/5 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                |  |        |
| 0.055 ~0.145 (0.075) | 0.040 ~0.050 (0.041) |           |             | O/N 0.060 ~0.145 (0.078) |                      | 0.040 ~0.050 (0.041) |  |        |
| 0.070 ~0.120 (0.073) |                      |           |             | T/N                      | 0.070 ~0.130 (0.091) |                      |  |        |
|                      |                      |           |             | S/N                      |                      |                      |  |        |
| 0.100 ~0.150 (0.118) |                      |           |             | 1W 0.117 (0.117)         | 0.117 ~0.130 (0.120) |                      |  |        |
|                      |                      |           |             | 2W                       | 0.118 ~0.180 (0.139) |                      |  |        |
| 0.118 (0.118)        |                      |           |             | 3W                       |                      |                      |  |        |
| 0.200 (0.200)        |                      | 0.08-0.13 | 0.02-0.025  | 1M                       | 0.125 (0.125)        | 有担先日付分               |  |        |
|                      |                      | 0.08-0.13 | 0.0300      | 2M                       |                      |                      |  |        |
|                      |                      | 0.08-0.13 | 0.025-0.033 | 3M                       |                      |                      |  |        |
|                      |                      | -         | 0.025-0.029 | 6M                       |                      |                      |  |        |
|                      |                      | -         | -           | 1Y                       |                      |                      |  |        |

## <<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 3/10 ~ 6/2 (84日間) 応札 3,370億円 落札 3,370億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 T-Bill3M 応札33兆3,155億円 落札5兆3,141億3,000万円(非競争入札:4,058億円) 3/10~6/9 0.0340% 按分 60.0541% 平均 0.0328%  
 30年利付国債(表面利率1.7%) 応札2兆3,737億円 落札5,546億円(I 非競争入札:450億円) 3/20~2044/3/20 1.647% 按分 25.6790% 平均 1.635%  
 預保借入(金融再生勘定) 517億円 3/14 ~2015/2/6 応札 3,581億円 落札 517億円 0.097% 按分 44.667% 平均 0.085%

「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

| << 3/7の日銀調節とレート予想 >> |            |        |            |     |           |
|----------------------|------------|--------|------------|-----|-----------|
| 日銀調節                 | 見送り        | 当座預金残高 | 1,131,000  | 前日比 | 18,900    |
| O/N                  | 0.06~0.075 | T/N    | 0.065~0.12 | S/N | 0.07~0.12 |

無担O/Nは、0.07%前後の出合いが中心となろう。

<< 6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、前日比横ばいの86兆6,000億円(当座預金残高見込は111兆2,000億円)。無担O/Nは、大手行から0.06%、地銀・信託業態を中心に0.07%の調達希望から始まった。0.071~0.07%へのギブン地合いの後も、ほぼ同水準で推移。試し取りも散見されつつ、本日の取引を終了した。ターム物はロールオーバーの案件が中心となった。共通担保オペが8,000億円オファーされ、結果は落札総額3,370億円で札割れとなった。

<< 6日のオープン市場動向 >>  
 現先レートは低位横ばい圏で推移。短国市場は、3M物の入札が実施された。W I 取引の段階から0.032~0.033%と強めの出合いが見られたこともあって、平均落札利回0.0328%、最高落札利回0.0340%と、前日の6M物と同様に入札自体も強めの結果になった。セカンダリーではショートカバーから0.025%まで買い進まれた。CP市場は10日発行となり石油、商社、鉄鋼業態でまとまった発行が見られ、総額1,750億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移。

<< 7日の材料 >>  
 \*1月の景気動向指数速報  
 \*2月のマネタリーベースと日本銀行の取引  
 \*米国1月の貿易収支 \*米国1月の消費者信用残高 \*米国2月の雇用統計

| <<コール2月の加重平均レート>> |    |          |             |
|-------------------|----|----------|-------------|
| (土日を含む)           | 無担 | 0.07554% | 有担 0.04100% |
| (営業日のみ)           | 無担 | 0.07658% | 有担 0.04100% |

| JGB新発10年債 |       | 日経平均株価(終値) |        | 為替(9時) | 102.36-37 |
|-----------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| 0.615     | 0.005 | 15,134.75  | 237.12 | 為替(5時) | 102.75-76 |

| 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                             | 2/27      | 2/28      | 3/3       | 3/4       | 3/5       | 3/6       |
| 日銀当預残                          | 1,129,800 | 1,140,300 | 1,119,000 | 1,109,900 | 1,110,800 | 1,112,100 |
| 準備預金残                          | 1,014,400 | 1,033,000 | 1,005,500 | 996,300   | 996,500   | 997,900   |
| レート                            | 0.073%    | 0.072%    | 0.074%    | 0.074%    | 0.078%    | 0.075%    |
| 月中平均                           | 0.07567%  | 0.07554%  | 0.07267%  | 0.07300%  | 0.07400%  | 0.07417%  |