

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/2/23(月) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	23日需給速報		24日需給予想	25日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 1,100	▲ 1,000
財政		▲ 18,500	3,600	▲ 1,000
資金過不足		▲ 18,900	2,500	▲ 2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,500		
65,630		▲ 2,700		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			25,000	
国庫短期証売却				
国債買入			12,200	5,400
CP等買入				
		▲ 400	▲ 200	
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				
ETF買入		200		
国債補充供給				
小計		▲ 400	37,000	5,400
当預増減		▲ 19,300	39,500	3,400

当座預金残高	1,791,100	2/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,625,300		67,400
積み終了先	1,317,200	2/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,313,000	積数	52,500
非準備先残高	165,800	1日平均	2,600
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	97.05% (実績)		28.57% (日数)

2/20のマナターベース		2,743,000	
2/20コール	合計	206,063	無担 76,448 有担 129,615
コール前日増減	計	1,507	無担 479 有担 1,028

2/23の加重平均レート(速報)				2/20の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.050 ~0.125 (0.078)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.130 (0.075)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.125 (0.083)				T/N		0.073 ~0.125 (0.086)		
0.125 (0.125)				S/N				
				1W		0.070 ~0.260 (0.129)		
0.114 (0.114)				2W		0.118 (0.118)		
				3W				
0.145 (0.145)				1M		0.118 (0.118)		有担先日付分
				2M				
				3M				
				6M				
				1Y				

## <<オペ情報、入札結果>>

国債買入	4,000億円	2/25	応札	11,607億円	落札	4,009億円	按分利回り較差	-0.012%	31.1%	平均利回り較差	-0.009%
国債買入	1,400億円	2/25	応札	3,268億円	落札	1,400億円	按分価格較差	0.26円	2.6%	平均価格較差	0.156円

「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

<< 2/24の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,830,600	前日比	39,500
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になると見込まれる。					

### << 23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、133兆1,000億円(当座預金残高見込みは179兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.073%、都銀からは0.07%での調達希望で始まった。出合いの中心は0.073~0.074%と先週末と同様、やや強めの立ち上がりとなった。一巡後は、調達レートを切り下げ、0.07%での出合いが数件見られる程度であった。また一部業態が試し取りを行ったため、加重平均が若干上昇した。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが中心となった。

### << 23日のオープン市場動向 >>

現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は特段イベントのない中、3M物が▲0.005~▲0.001%、1Y物が▲0.01%まで買い進まれる堅調な地合いとなった。CP市場は、償還1,200億円程度に対して、五・十日発行にあたることから、発行は3,000億円弱に膨らんだ。発行レートは概ね変わらず小高い水準での決着となっていた。

### << 24日の材料 >>

- \*1月の企業向けサービス価格指数
- \*イエレンFRB議長、上院銀行委員会で議会証言
- \*米国12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- \*米国2月のCB消費者信頼感指数
- \*ユーロ圏1月の消費者物価指数改定値
- \*40年利付国債入札(4,000億円、2/26発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、3/4借入)

JGB新発10年債	0.380	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	18,466.92	134.62	為替(9時)	119.07-09
						為替(5時)	119.20-23

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	2/16	2/17	2/18	2/19	2/20	2/23
日銀当預残	1,838,500	1,830,900	1,843,100	1,829,300	1,810,400	1,791,100
準備預金残	1,671,100	1,664,500	1,682,500	1,659,000	1,646,000	1,625,300
レート	0.075%	0.079%	0.077%	0.082%	0.075%	0.078%
月中平均	0.07388%	0.07418%	0.07433%	0.07474%	0.07477%	0.07491%