

2015/3/23(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	▲ 200	▲ 1,000	▲ 1,000
財政	▲ 4,600	3,100	18,000
資金過不足	▲ 4,800	2,100	17,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)	1,100	3,900	
67,427	▲ 1,000	▲ 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	8,700		10,500
CP等買入	5,000		
	▲ 200	▲ 300	
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			
ETF買入		100	
国債補完供給	即日 ▲ 400	400	
小計	13,200	15,300	10,500
当預増減	8,400	17,400	27,500

当座預金残高	1,921,100	3/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,763,200		88,700
積み終了先	1,415,200	3/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,414,100	積数	66,100
非準預先残高	157,900	1日平均	2,900
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	96.65% (実績)	25.81% (日数)	

3/20のマネタリーベース	2,850,300
3/20コール 合計	197,060 無担 66,670 有担 130,390
コール前日増減 計	2,220 無担 ▲ 833 有担 3,053

3/23 の加重平均レート(速報)				3/20 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 ~0.130 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.130 (0.066)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.063 ~0.120 (0.074)					0.050 ~0.130 (0.077)			
0.117 (0.117)					0.062 ~0.200 (0.116)			
		0.08-0.13	-					
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	-					
		-	-					
		-	▲0.01-▲0.009					

《オペ情報、入札結果》

国債補完	12,000億円	3/23	~	3/24 (1日間)	応札	35億円	落札	35億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債補完	7,980億円	3/23	~	3/24 (1日間)	応札	309億円	落札	309億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	3,000億円	3/25	応札	13,609億円	落札	3,002億円	按分利回り較差	0.009%	94.6%	平均利回り較差	0.011%	
国債買入	3,500億円	3/25	応札	12,871億円	落札	3,505億円	按分利回り較差	-0.002%	88.7%	平均利回り較差	-0.002%	
国債買入	4,000億円	3/25	応札	11,354億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.023%	90.2%	平均利回り較差	-0.020%	
被災地支援(第47回) 3/27~2016/3/25 (364日間) 貸付予定総額 0億円 貸付利率0.10 %												

「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

《 3/24の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,938,500	前日比	17,400
O/N	0.06~0.075	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12
無担O/Nは0.065%前後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、前日比2兆5,000億円増の144兆5,000億円(当座預金残高見込みは過去最高の192兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.065%前後での調達で始まった。一巡後は、0.06%台前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。

《 23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。短国市場は動意に乏しく、閑散とした中、1Y物で▲0.01~▲0.009%での出合いが見られた程度であった。CP市場は、五・十日にかかる発行となり、電機・機械・通信業態からの大型発行案件が見られたことで、発行総額は3,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。

《 24日の材料 》

- *米国2月の消費者物価指数
- *米国2月の新築一戸建て販売件数
- *英国2月の消費者物価指数
- *流動性供給 (4,000億円、3/26発行)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.02-04
0.310 ▲ 0.015	19,754.36 194.14	為替(5時)	120.07-08

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	3/16	3/17	3/18	3/19	3/20	3/23
日銀当預残	1,834,300	1,852,500	1,887,600	1,890,200	1,912,700	1,921,100
準備預金残	1,677,800	1,691,700	1,728,100	1,716,400	1,760,300	1,763,200
レート	0.075%	0.075%	0.075%	0.071%	0.066%	0.065%
月中平均	0.07594%	0.07588%	0.07583%	0.07558%	0.07427%	0.07387%