

2015/3/27(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	27日需給速報	30日需給予想	31日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 2,300	100	100
財政	▲ 2,400	10,100	7,200
資金過不足	▲ 4,700	10,200	7,300
貸出	600	▲ 600	
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			7,500
国庫短期証売却			
国債買入	10,600		10,300
CP等買入			6,000
	▲ 1,100	▲ 700	
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 ▲ 100		
	100	100	
小計	10,200	▲ 1,200	23,800
当預増減	5,500	9,000	31,100

当座預金残高	1,974,800	3/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,828,900		35,000
積み終了先	1,500,800	3/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,499,200	積数	20,400
非準備先残高	145,900	1日平均	1,200
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,971,300		
準備預金進捗率	98.97%	(実績)	45.16% (日数)

3/26のマナタリーベース	2,911,400
3/26コール 合計	198,341 無担 68,442 有担 129,899
コール前日増減 計	▲ 4,675 無担 ▲ 5,936 有担 1,261

3/27 の加重平均レート(速報)				3/26 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		
0.060 ~0.130 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.130 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.061 ~0.121 (0.072)				T/N	0.062 ~0.120 (0.082)			
0.040 ~0.060 (0.044)				S/N	0.280 (0.280)			
0.065 ~0.190 (0.116)				1W	0.030 ~0.120 (0.053)			
				2W				
				3W				
		0.08-0.13	-	1M		有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.018-0.03	3M	0.117 (0.117)			
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完	11,885億円	3/27	~ 3/30 (3日間)	0億円	0億円	按分	平均	(即)
国債補完	8,000億円	3/27	~ 3/30 (3日間)	応札 104億円	落札 104億円	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	7,500億円	3/31	応札 18,300億円	落札 7,504億円	按分利回り較差	68.2%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	3,000億円	3/31	応札 6,556億円	落札 3,001億円	按分利回り較差	97.2%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	3,500億円	3/31	応札 11,264億円	落札 3,501億円	按分利回り較差	62.1%	平均利回り較差	0.032%
国債買入	2,400億円	3/31	応札 6,478億円	落札 2,406億円	按分利回り較差	96.5%	平均利回り較差	0.048%
国債買入	1,400億円	3/31	応札 4,268億円	落札 1,401億円	按分利回り較差	97.9%	平均利回り較差	0.047%
J-REIT買入	12億円	約定日 3/27						

「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の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

《 3/30の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,983,800	前日比	9,000
O/N	0.055~0.07	T/N	0.03~0.12	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。					

《 27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1兆4,000億円増の149兆9,000億円(当座預金残高見込みは過去最高の197兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・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、大手行の調達も見られず、出合いは閑散であった。

《 27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。短国市場は短国買入オペが7,500億円でオファーされた。オファー見送り予想もあった中で、結果は平均利回り較差+0.006%、按分利回り較差+0.004%と小甘い結果となった。引け値が低い特定の銘柄を中心に応札が集まったとみられる。オペ後は3M物が0.018%まで買い進まれる展開となった。CP市場は年度末発行にあたるため、大型発行案件が少なく、発行総額は3,700億円程度にとどまった。有利子負債圧縮による市場残高の減少が顕著な中、購入意欲は底堅く、全般的に落ち着いた水準となった。

《 30日の材料 》

*2月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲1.8%)

*米国2月の個人所得・消費支出

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	119.19-21
0.375 0.050	19,285.63 ▲ 185.49	為替(5時)	119.43-46

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	3/20	3/23	3/24	3/25	3/26	3/27
日銀当預残	1,912,700	1,921,100	1,938,400	1,968,700	1,969,300	1,974,800
準備預金残	1,760,300	1,764,100	1,781,600	1,809,400	1,814,100	1,828,900
レート	0.066%	0.065%	0.064%	0.065%	0.065%	0.067%
月中平均	0.07427%	0.07387%	0.07346%	0.07312%	0.07281%	0.07221%