

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/1/23(金) <<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	26日需給予想	27日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 800	1,100	1,000
財政	3,100	▲ 19,700	6,000
資金過不足	2,300	▲ 18,600	7,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)		2,900	
77,139		▲ 4,100	
国債買現			
0			
CP買現			
0			
国庫短期証買入			30,000
国庫短期証売却			
国債買入			11,800
CP等買入	3,500	▲ 1,000	
	▲ 500		
貸出支援基金			
(成長) 44,583			
(増加) 189,789			
被災地支援	0		
3,252	0		
社債等買入	▲ 200		
ETF買入	300	300	
国債補完供給	即日 ▲ 100	100	
小計	3,000	▲ 1,800	41,800
当預増減	5,300	▲ 20,400	48,800

当座預金残高	1,803,100	1/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,629,900		96,800
積み終了先	1,316,600	1/26以降の残り所要積立額	
超過準備	1,312,800	積数	65,800
非準預先残高	173,200	1日平均	3,100
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			1,978,000
準備預金進捗率	96.67%	(実績)	32.26% (日数)

1/22のマナタリーベース	2,734,600
1/22コール合計	196,303無担 75,866有担 120,437
コール前日増減	計 ▲ 724無担 281有担 ▲ 1,005

1/23 の加重平均レート(速報)				1/22 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	有担当当日分	
0.060 ~0.080 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.074 ~0.120 (0.089)				T/N		0.075 ~0.120 (0.085)		
				S/N		0.125 ~0.200 (0.163)		
0.069 ~0.260 (0.119)				1W		0.088 ~0.117 (0.094)		
0.115 ~0.118 (0.118)				2W				
0.118 (0.118)				3W				
0.115 (0.115)		0.08-0.12	-	1M		0.118 ~0.145 (0.136)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.005-▲0.001	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	8,000億円	1/23	~ 1/26 (3日間)	応札	62億円	落札	62億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	30,000億円	1/27	応札	73,892億円	落札	30,000億円	全取利回り較差	0.023%		平均利回り較差	0.023%
国債買入	4,000億円	1/27	応札	10,510億円	落札	4,000億円	全取利回り較差	0.016%		平均利回り較差	0.017%
国債買入	4,000億円	1/27	応札	7,103億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	-0.029%	45.5%	平均利回り較差	-0.021%
国債買入	2,400億円	1/27	応札	3,707億円	落札	2,401億円	按分利回り較差	-0.092%	12.7%	平均利回り較差	-0.064%
国債買入	1,400億円	1/27	応札	3,386億円	落札	1,402億円	按分利回り較差	-0.047%	94.9%	平均利回り較差	-0.040%

「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

<< 1/26の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,782,700	前日比	▲ 20,400
O/N	0.06~0.08	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12
無担O/Nは0.07~0.075%程度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、前日比3,000億円減少の132兆2,000億円(当座預金残高見込みは180兆1,000億円)。無担O/Nは朝方0.074%の出合いで立ち上がり、その後は大手行から0.068%、地銀・信託業態を中心に0.073%前後の調達が見られた。一巡後は0.07~0.073%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関しては、大手行から1W物が0.117%、2W物が0.118%で調達が行われた。

<< 23日のオープン市場動向 >>

現先レートは横ばい圏で推移した。短国市場は短国買入オペが30,000億円で実施され、全取利回り較差は+0.023%となるなど、売却ニーズの強さを反映した結果となった。オペ後は3M▲0.005%の出合いが見られた程度であった。CP市場は入札件数・発行額共に少なく、発行総額600億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばいながらも、一部銘柄では若干のレート上昇が見られた。

<< 26日の材料 >>

*日銀金融政策決定会合議事要旨(12月18、19日開催分)

*12月の貿易統計

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	118.70-73
0.250 ▲ 0.075	17,511.75 182.73	為替(5時)	118.21-22

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	1/16	1/19	1/20	1/21	1/22	1/23
日銀当預残	1,809,300	1,806,100	1,785,500	1,828,300	1,797,800	1,803,100
準備預金残	1,644,500	1,642,200	1,615,600	1,660,200	1,630,000	1,629,900
レート	0.074%	0.074%	0.077%	0.074%	0.075%	0.073%
月中平均	0.07194%	0.07205%	0.07230%	0.07238%	0.07250%	0.07256%