

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/1/28(水) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	28日需給速報		29日需給予想	30日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		500	▲ 500	▲ 600
財政		3,000	▲ 3,900	1,900
資金過不足		3,500	▲ 4,400	1,300
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
75,979				
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		4,400		12,000
CP等買入				3,500
		▲ 200	▲ 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		▲ 100	▲ 200	
ETF買入		400	100	
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		4,400	▲ 200	15,500
当預増減		7,900	▲ 4,600	16,800
当座預金残高	1,841,700	1/28以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,651,400	53,300		
積み終了先	1,345,000	1/29以降の残り所要積立額		
超過準備	1,344,900	積数		
非準預先残高	190,300	1日平均		
		2,700		
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	97.54%	(実績)	41.94%	(日数)

1/27のマネタリーベース		2,770,200	
1/27コール	合計	204,067	無担 81,581 有担 122,486
コール前日増減	計	3,766	無担 2,080 有担 1,686

1/28の加重平均レート(速報)			1/27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 ~0.125 (0.087)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.070 ~0.120 (0.090)				T/N	0.071 ~0.120 (0.077)		
				S/N			
0.081 ~0.117 (0.093)				1W	0.117 (0.117)		
0.118 (0.118)				2W	0.118 (0.118)		
0.140 (0.140)				3W	0.114 (0.114)		
		0.08-0.12	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	0.0000	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	1/28 ~ 1/29 (1日間)	0億円	0億円	按分	平均	(即)
国債補完	4,000億円	1/28 ~ 1/29 (1日間)	応札 78億円	落札 78億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債買入	4,000億円	1/30	応札 10,836億円	落札 4,002億円	按分利回り較差 0.013%	95.1%	平均利回り較差 0.014%
国債買入	4,000億円	1/30	応札 13,728億円	落札 4,005億円	按分利回り較差 -0.002%	23.9%	平均利回り較差 0.000%
国債買入	4,000億円	1/30	応札 12,553億円	落札 4,006億円	按分利回り較差 -0.008%	63.1%	平均利回り較差 -0.007%
預保借入(金融再生勘定)	570億円	2/6~2016/2/5	応札 2,976億円	落札 570億円	0.089%	按分89.000%	平均 0.088%
ETF買入	341億円	約定日 1/28					
J-REIT買入	12億円	約定日 1/28					

「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

<< 1/29の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,837,100	前日比	▲ 4,600
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%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 28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1兆円増加の136兆4,000億円(当座預金残高見込みは184兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行から0.068%、地銀および信託業態から0.069~0.072%の調達希望で始まり、出合いの中心レートは0.07%近辺となった。一部業態より0.08~0.125%で大規模な試し取りが行われたため、加重平均レートは大幅に上昇したものの、全体的な調達ニーズは限定的であり、一巡後は0.068~0.071%近辺で出合いが散見されつつ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物は0.117%、2W物は0.118%で調達が行われた。

<< 28日のオープン市場動向 >>
現先レートS/Nは、横ばい圏で推移した。短国市場は、全般的に閑散な中、3M0.000%の出合いが見られた。CP市場は、月末発行にあたったことで、発行総額が8,000億円程度まで膨らんだ。期間が短い条件のものについてレート上昇が予想されたものの、0.10%以上では購入意欲が依然として強く、発行レートは概ね横ばいであった。

<< 29日の材料 >>
*12月の商業販売統計速報(経済産業省 8:50)
*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、2/2発行)
*2年利付国債入札(27,000億円、2/15発行)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	117.78-81
0.285	0.060	為替(5時)	118.13-15
	17,795.73		27.43

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	1/21	1/22	1/23	1/26	1/27	1/28
日銀当預残	1,828,300	1,797,800	1,803,100	1,782,100	1,833,800	1,841,700
準備預金残	1,660,200	1,630,000	1,630,500	1,615,400	1,657,800	1,651,400
レート	0.074%	0.075%	0.073%	0.071%	0.073%	0.087%
月中平均	0.07238%	0.07250%	0.07256%	0.07250%	0.07252%	0.07304%