CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/1/29(木)　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	29日需給速報	30日需給予想	2日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 700	▲ 200	2,000
財政	▲ 4,200	1,300	▲ 30,000
資金過不足	▲ 4,900	1,100	▲ 28,000
貸出			
売出手形 0			
本店共通 0			
全店共通 0			
共通(固定) 75,979			800 ▲ 1,600
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		12,100	
CP等買入	▲ 200	3,500 ▲ 3,800	
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	▲ 200	▲ 100	
ETF買入	100		
国債補完供給	100		
小計	▲ 200	11,700	▲ 800
当預増減	▲ 5,100	12,800	▲ 28,800

当座預金残高	1,836,600	1/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,661,900		48,600
積み終了先	1,360,200	1/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,360,200	積数	44,000
非準預先残高	174,700	1日平均	2,600
積み期間(1/16～2/15)の所要準備額(積数)			1,977,800

準備預金進捗率　97.78%　(実績)　45.16%　(日数)

1/28のマネタリーベース						2,777,500
1/28コール	合計	213,815	無担	92,485	有担	121,330
コール前日増減	計	9,748	無担	10,904	有担	▲ 1,156

≪ 1/30の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	1,849,400	前日比	12,800
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。

≪ 29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1,000億円減少の136兆3,000億円(当座預金残高見込みは183兆7,000億円)。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0.07～0.072%の調達希望で始まり、出合いの中心レートは0.07%近辺であった。一巡後は0.069～0.071%近辺で出合いが散見され、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。3M物の共通担保オペが8,000億円オファーされ、落札総額770億円（期落ち分1,550億円）で札割れとなった。

≪ 29日のオープン市場動向 ≫

現先レートS/Nは、同水準で推移した。短国市場は、3M物の入札が実施された。入札前のWI取引において▲0.007%の出合いが見られていたものの、平均落札利回り▲0.0027%、最高落札利回り0.000%と概ね予想通りの結果となった。セカンダリーは3M▲0.003～0.000%の出合いが見られた。CP市場は、鉄鋼・電機業態から大型の発行が実施され、発行総額は2,600億円程度となった。発行レートに特段の変化はなく、概ね横ばい圏であった。

≪ 30日の材料 ≫

*12月の完全失業率(市場予想：3.5%)
*12月の有効求人倍率(市場予想：1.12倍)
*12月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比▲2.5%)
*12月全国・1月都区部消費者物価指数
　市場予想：全　　国(12月)前年同月比(除く生鮮)：＋2.6%
　　東京都区部(1月)前年同月比(除く生鮮)：＋2.2%
*12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比＋1.3%)
*12月の住宅着工統計
*米国10-12月期のGDP速報値　*米国1月のシカゴPM景況感指数
*ユーロ圏1月の消費者物価指数速報値
*交付税特別会計借入(10,500億円、2/12借入)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	117.60-61
0.285	0.000	17,606.22	▲ 189.51	為替(5時)	117.69-72

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	1/22	1/23	1/26	1/27	1/28	1/29
日銀当預残	1,797,800	1,803,100	1,782,100	1,833,800	1,841,700	1,836,600
準備預金残	1,630,000	1,630,500	1,615,400	1,657,800	1,653,200	1,661,900
レート	0.075%	0.073%	0.071%	0.073%	0.087%	0.071%
月中平均	0.07250%	0.07256%	0.07250%	0.07252%	0.07304%	0.07297%

1/29 の加重平均レート(速報)

無担 (平均)	有担 (平均)	CP気配a-1	短国
0.060 ～0.135 (0.071)	0.030 ～0.040 (0.031)		
0.073 ～0.123 (0.075)			
0.075 ～0.082 (0.080)			
0.118 (0.118)			
		0.08-0.12	-
		0.08-0.12	-
		0.08-0.12	▲0.003-0.000
		-	-
		-	-

1/28 の加重平均レート(確報)　単位 (%)

	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
O/N	0.055 ～0.125 (0.087)		0.030 ～0.040 (0.031)
T/N		0.070 ～0.120 (0.090)	
S/N			
1W		0.081 ～0.117 (0.108)	
2W		0.118 (0.118)	
3W		0.140 (0.140)	
1M			有担先日付分
2M			
3M		0.160 (0.160)	
6M			
1Y			

≪オペ情報、入札結果≫

全店共通　8,000億円　2/2　～　5/7　(94日間) 応札　770億円　落札　770億円　0.100%　全 取　平 均　0.100% (固定)
T-Bill3M　応札30兆8,069億7,000万円　落札5兆2,697億5,000万円(非競争入札：4,602億円) 2/2～5/7 0.000% 按分7.8136% 平均▲0.0027%
2年利付国債(表面利率0.1%) 応札10兆8,718億円　落札2兆5,580億円(I 非競争入札：1,408億円) 2/16～2017/2/15 0.009% 按分57.6529% 平均0.006%
ETF買入　341億円　約定日 1/29
J-REIT買入　12億円　約定日 1/29

「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