

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/2/12(木) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	12日需給速報		13日需給予想		16日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		200	▲ 100		1,000	
財政		▲ 8,000	68,900	▲ 26,000		
資金過不足		▲ 7,800	68,800	▲ 25,000		
貸出			▲ 100			
売出手形						
本店共通						
全店共通						
共通(固定)			3,900	1,800		
77.497			▲ 4,900	▲ 3,400		
国債買現						
CP買現						
国庫短期証買入		25,000				
国庫短期証売却						
国債買入		4,700		7,800		
CP等買入						
		▲ 300	▲ 400			
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						
ETF買入			600			
国債補完供給						
小計		29,400	▲ 900	6,200		
当増減		21,600	67,900	▲ 18,800		

当座預金残高	1,800,300	2/12以降の残り所要積立額	1,600
準備預金残高	1,635,400		
積み終了先	1,349,100	2/13以降の残り所要積立額	1,300
超過準備	1,349,100	積数	400
非準備先残高	164,900	1日平均	400
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,986,300		
準備預金進捗率	99.93% (実績)	90.32% (日数)	

2/10のマネタリーベース		2,710,000	
2/10コール	合計 200,925	無担 78,967	有担 121,958
コール前日増減	計 ▲ 4,720	無担 ▲ 4,887	有担 167

2/12の加重平均レート(速報)				2/10の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.050 ~0.130 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)	CP気配a-1	短国	O/N	0.060 ~0.125 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.080 (0.074)				T/N		0.073 ~0.075 (0.073)	
0.125 (0.125)				S/N			
0.117 ~0.130 (0.119)				1W		0.117 (0.117)	
0.160 (0.160)				2W			
				3W			
		0.08-0.12	-	1M		0.200 (0.200)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.004-0.005	3M			
		-	▲0.009-▲0.007	6M			
		-	-	1Y			

## <<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	2/16 ~ 5/18 (91日間) 応札	1,751億円	落札	1,751億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債買入	4,000億円	2/16 応札	8,553億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.009%	71.5%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	2,400億円	2/16 応札	7,646億円	落札	2,406億円	按分利回り較差	-0.002%	89.0%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	1,400億円	2/16 応札	3,708億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	-0.019%	5.2%	平均利回り較差	-0.009%
社債買入	1,000億円	2/18 応札	2,575億円	落札	1,000億円	按分レート	0.035%	50.0%	平均落札レート	0.100%
T-Bill3M	応札28兆9,280億円	落札5兆2,624億5,000万円(非競争入札:4,175億円)	2/16~5/18	0.0020%	按分12.8163%	平均▲0.0004%				

<< 2/13の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,868,200	前日比	67,900
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

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。

## << 12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1兆9,000億円増加の135兆円(当座預金残高見込みは180兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.068~0.07%、地銀・信託から0.07~0.073%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.073%近辺の出合いが中心となった。一巡後は、0.071%が中心の出合いとなり、底堅く推移した。ターム物は、1W物の期間で大手行による幅広い調達が確認された。本日の共通担保資金供給オペは、3M物8,000億円のオファーに対し、応札額1,751億円(期落ち額3,370億円)の札割れとなった。

## << 12日のオープン市場動向 >>

現先取引S/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は3Mの入札が実施され、各利回りは平均▲0.004%、按分0.002%と昨年11月13日実施分以来のプラス圏での決着となった。概ね事前予想通りの結果であったが、セカンダリー市場では調整売りから0~0.005%の出合いが見られた。CP発行市場は昨日同様15日にかかる取引となったことで、大型案件を中心に発行総額は2,200億円弱に膨らんだ。発行レートは0.10%台中心であった。

## << 13日の材料 >>

- \*12月のマネタリーサーベイ
- \*米国2月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- \*ユーロ圏10-12月期のGDP速報値
- \*5年利付国債入札(27,000億円、2/17発行)

JGB新発10年債	0.395	0.005	日経平均株価(終値)	17,979.72	327.04	為替(9時)	120.20-22
						為替(5時)	120.27-28

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	2/4	2/5	2/6	2/9	2/10	2/12
日銀当預残	1,800,800	1,784,100	1,796,800	1,772,600	1,778,700	1,800,300
準備預金残	1,631,300	1,619,400	1,634,100	1,613,700	1,617,600	1,635,400
レート	0.075%	0.076%	0.073%	0.081%	0.074%	0.074%
月中平均	0.07250%	0.07320%	0.07313%	0.07400%	0.07400%	0.07400%

「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