

2015/2/16(月)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	16日需給速報 即日 金額	17日需給予想 金額	18日当社予想 金額
銀行券	1,000	100	0
財政	▲ 32,300	▲ 20,600	▲ 2,000
資金過不足	▲ 31,300	▲ 20,500	▲ 2,000
貸出		▲ 100	
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)	1,800	4,700	
74,828	▲ 3,400	▲ 12,700	
国債買現			
0			
CP買現			
0			
国庫短期証買入		20,000	
国庫短期証売却			
国債買入	8,000		12,000
CP等買入			
	▲ 800	▲ 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		1,000
ETF買入	300		
国債補完供給	▲ 400		
即日	300	400	
小計	5,700	12,100	13,000
当預増減	▲ 25,600	▲ 8,400	11,000

当座預金残高	1,838,500	2/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,670,700		1,776,900
積み終了先	451,600	2/17以降の残り所要積立額	
超過準備	343,200	積数	748,300
非準備先残高	167,800	1日平均	27,700
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,776,900		
準備預金進捗率	57.89%	(実績)	3.57% (日数)

2/13のマナタリーベース	2,795,100
2/13コール 合計	200,256 無担 78,956 有担 121,300
コール前日増減 計	▲ 2,425 無担 ▲ 2,263 有担 ▲ 162

2/16 の加重平均レート(速報)					2/13 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			
0.050 ~0.130 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)				O/N 0.060 ~0.125 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)			
0.073 ~0.125 (0.099)					T/N	0.071 ~0.074 (0.073)				
0.100 ~0.125 (0.101)					S/N					
0.090 (0.090)					1W	0.068 ~0.260 (0.126)				
					2W					
					3W					
0.170 (0.170)		0.08-0.12	-		1M		有担先日付分			
		0.08-0.12	-		2M					
		0.08-0.12	-		3M					
		-	▲0.009		6M					
		-	-		1Y					

《オペ情報、入札結果》

国債補完	6,000億円	2/16	~ 2/17 (1日間)	応札	381億円	落札	381億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	2/18	応札	13,001億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.001%	73.1%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	4,000億円	2/18	応札	10,313億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.010%	66.5%	平均利回り較差	0.013%
国債買入	4,000億円	2/18	応札	13,709億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	0.020%	66.6%	平均利回り較差	0.021%
J-REIT買入	12億円	約定日	2/16								

「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録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

《 2/17の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,830,100	前日比	▲ 8,400
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

試し取りが行われる見込みであり、無担O/Nの加重平均は高めになることが予想される。

《 16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、137兆1,000億円(当座預金残高見込みは183兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.073%、大手行からは0.068%での調達希望が始まった。出合いの中心は0.072%となった。一巡後も0.07%近辺での出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。また、一部業態が試し取りを行った結果、加重平均は若干上昇した。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

《 16日のオープン市場動向 》

現先S/N物は先週末比小幅低下した。短国市場は様子見姿勢が強く、出合いはほとんど見られなかつた。CP市場は、償還総額600億円程度に対し、発行案件が少ないこともあって発行総額は700億円程度にとどまった。発行レートは、小幅上昇する銘柄が目立った。

《 17日の材料 》

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、18日まで)
- *英国1月の消費者物価指数
- *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、2/20発行)
- *20年利付国債入札(12,000億円、2/19発行)

《コール1月積み期間分の加重平均レート》

(土日を含む)	無担	0.07394%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07450%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	118.61-65
0.450 0.030	18,004.77 91.41	為替(5時)	118.60-61

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	2/6	2/9	2/10	2/12	2/13	2/16
日銀当預残	1,796,800	1,772,600	1,778,700	1,800,300	1,864,100	1,838,500
準備預金残	1,634,100	1,613,700	1,617,600	1,635,600	1,687,100	1,670,700
レート	0.073%	0.081%	0.074%	0.074%	0.073%	0.075%
月中平均	0.07313%	0.07400%	0.07400%	0.07400%	0.07380%	0.07388%