

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/1/5(火) <セントラル短資株式会社>

<<資金需給>>

単位 億円

	5日需給速報		6日需給予想	7日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		6,100	4,600	4,000
財政		▲ 3,300	▲ 21,300	▲ 24,000
資金過不足		2,800	▲ 16,700	▲ 20,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
63,515				
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		11,100	5,600	
CP等買入		▲ 300	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 271,714				
被災地支援				
3,143				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給				
小計		10,800	5,500	0
当預増減		13,600	▲ 11,200	▲ 20,000

<< 1/6の日銀調節とレート予想 >>

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,537,800	前日比	▲ 11,200
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07~0.08%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 5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6,000億円増の187兆9,000億円(当座預金残高見込みは254兆7,000億円)。朝方の無担O/Nの立ち上がりは昨日よりもやや上昇し、大手行・地銀・信託業態を中心に0.072~0.074%近辺の調達希望で始まった。まとまった金額に対しては0.075~0.076%程度での出合いも一部でみられた。一巡後は調達レートが低下し、0.07~0.075%程度の出合いが散見される中で本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から3W物の0.118%でまとまった調達が見られた。

<< 5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2M~3Mゾーンにオフアービッドの気配がそれぞれ見られたものの、特段出合いには至らず、本日も様子見閑散となった。CP市場はノンバンク業態から大型発行案件が見られ、発行総額は1,100億円程度となった。発行レートは、引き続き高めめの水準での決着が中心となった。

<< 6日の材料 >>

- *1月の日銀当座預金増減要因見込み
- *米国11月の貿易収支
- *米国11月の製造業新規受注・出荷・在庫
- *米国12月のISM非製造業景況指数
- *交付税特別会計借入(10,500億円、1/15借入)

<< コール12月の加重平均レート >>

(土日を含む)	無担	0.07368%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07486%	有担	0.03100%

当座預金残高	2,549,000	1/5以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,324,700		300
積み終了先	1,879,900	1/6以降の残り所要積立額	
超過準備	1,879,900	積数	300
非準預先残高	224,300	1日平均	0
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			2,042,000
準備預金進捗率	99.99% (実績)		67.74% (日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	119.46-48
0.255 ▲ 0.005	18,374.00 ▲ 76.98	為替(5時)	119.42-43

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	12/25	12/28	12/29	12/30	1/4	1/5
日銀当預残	2,535,000	2,531,200	2,527,400	2,530,200	2,535,400	2,549,000
準備預金残	2,313,600	2,312,200	2,308,200	2,306,900	2,312,300	2,324,700
レート	0.073%	0.073%	0.073%	0.038%	0.070%	0.074%
月中平均	0.07637%	0.07625%	0.07614%	0.07368%	0.04600%	0.05160%

1/4のマネタリーベース				3,560,400		
1/4コール合計	198,702	無担	62,236	有担	136,466	
コール前日増減	計	5,383	無担	5,749	有担	▲ 366

1/5の加重平均レート(速報)				1/4の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.060 ~0.125 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.030 ~0.125 (0.070)		0.060 ~0.130 (0.079)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.070 ~0.121 (0.083)								
0.117 ~0.130 (0.121)				1W	0.117 (0.117)	0.130 (0.130)		
0.065 ~0.160 (0.117)				2W	0.118 (0.118)	0.117 ~0.310 (0.132)		
				3W		0.118 (0.118)		
0.170 (0.170)		0.07~0.12	-	1M	0.230 (0.230)	0.165 ~0.630 (0.187)	有担先日付分	
		0.07~0.11	-	2M		0.125 (0.125)		
		0.07~0.11	-	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<< オペ情報、入札結果 >>

米ドル資金供給(固定金利方式) 1/7~1/14 (7日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.850%
 10年利付国債(表面利率0.3%) 応札7兆1,069億円 落札2兆1,861億円(I非競争入札:2,110億円) 1/7~2025/12/20 0.258% 按分95.9208% 平均0.254%
 J-REIT買入 12億円 約定日 1/5

「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