

2016/1/6(水)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	6日需給速報 即日 金額	7日需給予想 金額	8日当社予想 金額
銀行券	4,800	2,900	3,000
財政	▲ 20,500	▲ 21,400	4,000
資金過不足	▲ 15,700	▲ 18,500	7,000
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	5,600		12,700
CP等買入	▲ 100	▲ 300	
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	5,500	▲ 300	12,700
当預増減	▲ 10,200	▲ 18,800	19,700

当座預金残高	2,538,800	1/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,316,200		300
積み終了先	1,871,400	1/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,871,400	積数	200
非準備先残高	222,600	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)	70.97% (日数)	

1/5のマネタリーベース	3,567,900
1/5コール 合計	224,640 無担 78,544 有担 146,096
コール前日増減 計	25,938 無担 16,308 有担 9,630

1/6 の加重平均レート(速報)				1/5 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	
0.060 ~0.130 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.125 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.070 ~0.121 (0.086)				T/N		0.070 ~0.121 (0.080)		
				S/N				
0.098 ~0.155 (0.116)				1W	0.118 (0.118)	0.117 ~0.130 (0.121)		
0.074 ~0.118 (0.091)				2W	0.118 ~0.160 (0.132)	0.065 ~0.160 (0.116)		
0.118 ~0.240 (0.164)				3W		0.118 (0.118)		
		0.07-0.12	-	1M		0.170 (0.170)	有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	-	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.115-▲0.105	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完	4,000億円	1/6	~	1/7 (1日間)	応札	2億円	落札	2億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	1/8	応札	11,122億円	落札	4,000億円	全取利回り較差		0.016%		平均利回り較差	0.016%
国債買入	4,200億円	1/8	応札	17,369億円	落札	4,212億円	按分利回り較差		-0.003%	3.0%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	4,500億円	1/8	応札	13,004億円	落札	4,513億円	按分利回り較差		-0.005%	76.7%	平均利回り較差	-0.004%
交付税特会	1兆500億円	1/15~7/15	応札	3兆6,250億円	落札	1兆500億円	0.090% 按分50.0000%	平均0.076%				
ETF買入	352億円	約定日 1/6										

「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

《 1/7の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,520,000	前日比	▲ 18,800
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。					

《 6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1兆1,000億円減の186兆8,000億円(当座預金残高見込みは253兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態を中心に0.074~0.075%近辺の調達希望が始まった。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。取り急ぐ動きはみられず、一巡後の出合いは昨日と同水準の0.07~0.075%前後を中心に推移し、本日の取引を終了した。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。

《 6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。短国市場は入札を抑え、オファービッドの気配は見られたものの、1Y物で引け際に▲0.115~▲0.105%の出合いが見られた程度で、終日閑散だった。CP市場は石油、商社業態から大型発行案件が見られ、発行総額は900億円程度となった。発行レートは概ね横ばいでの決着となった。

《 7日の材料 》

*国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、1/12発行)

*30年利付国債入札(8,000億円、1/12発行)

《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%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	119.10-11
0.249 ▲ 0.006	18,191.32 ▲ 182.68	為替(5時)	118.73-75

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	12/28	12/29	12/30	1/4	1/5	1/6
日銀当預残	2,531,200	2,527,400	2,530,200	2,535,400	2,549,000	2,538,800
準備預金残	2,312,200	2,308,200	2,306,900	2,312,300	2,325,800	2,316,200
レート	0.073%	0.073%	0.038%	0.070%	0.074%	0.075%
月中平均	0.07625%	0.07614%	0.07368%	0.04600%	0.05160%	0.05550%