

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/1/25(月) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

	25日需給速報		26日需給予想	27日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		500	100	0
財政		▲ 2,100	2,900	▲ 3,000
資金過不足		▲ 1,600	3,000	▲ 3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		3,100		
62,714		▲ 3,300		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			25,000	
国庫短期証売却				
国債買入			13,000	4,900
CP等買入				
		▲ 800	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 271,714				
被災地支援				
3,144				
社債等買入		▲ 400		
ETF買入		100	300	
国債補完供給				
小計		▲ 1,300	38,200	4,900
当預増減		▲ 2,900	41,200	1,900

<< 1/26の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,584,700	前日比	41,200
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。					

### << 25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8,000億円減少の188兆4,000億円(当座預金残高見込みは254兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.073%近辺、地銀・信託業態から0.073~0.075%近辺の調達希望。朝方の出合いは0.073~0.075%が中心。一巡後は0.07~0.075%のレンジでの出合いが見られた。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

### << 25日のオープン市場動向 >>

現先S/N物は低位横ばいで推移。短国市場は、全般的に小動きな中、店頭買いから3M物で▲0.035%のまとまった出合いが見られた。CP市場は、一部に大型の発行案件が見られたものの発行総額は700億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。

### << 26日の材料 >>

- \*12月の企業向けサービス価格指数
- \*米国FOMC(1日目)
- \*米国11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- \*米国1月の米CB消費者信頼感指数
- \*流動性供給入札(5,000億円、1/28発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、2/4借入)

当座預金残高	2,543,500	1/25以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,328,500		63,200
積み終了先	1,874,800	1/26以降の残り所要積立額	
超過準備	1,874,800	積数	55,100
非準備先残高	215,000	1日平均	2,600
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	2,057,100		
準備預金進捗率	97.32% (実績)		32.26% (日数)

JGB新発10年債	0.220	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,110.91	152.38	為替(9時)	118.55-58
						為替(5時)	118.56-58

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	1/18	1/19	1/20	1/21	1/22	1/25
日銀当預残	2,541,100	2,564,700	2,561,800	2,538,100	2,546,400	2,543,500
準備預金残	2,330,600	2,360,800	2,345,500	2,327,100	2,333,000	2,328,500
レート	0.074%	0.076%	0.074%	0.075%	0.075%	0.075%
月中平均	0.06889%	0.06926%	0.06950%	0.06976%	0.07042%	0.07060%

1/22のマナタリーベース				3,540,500		
1/22コール	合計	230,627	無担	88,133	有担	142,494
コール前日増減	計	▲ 6,340	無担	▲ 4,124	有担	▲ 2,216

1/25の加重平均レート(速報)				1/22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		有担当日分	
0.060 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)					O/N	0.060 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.050 ~0.125 (0.081)				T/N		0.073 ~0.121 (0.082)			
				S/N					
0.099 ~0.130 (0.115)				1W		0.130 (0.130)			
0.077 ~0.114 (0.083)				2W		0.070 ~0.340 (0.086)			
				3W					
				1M					
		0.07-0.12	-	2M					有担先日付分
		0.07-0.11	▲0.015	3M					
		0.07-0.11	▲0.035	6M					
		-	-	1Y					

## <<オペ情報、入札結果>>

国債買入 4,509億円 1/27 応札 13,423億円 落札 4,509億円 按分利回り較差 -0.009% 73.6% 平均利回り較差 -0.008%  
 国債買入 400億円 1/27 応札 1,825億円 落札 401億円 按分価格較差 -0.270円 75.6% 平均価格較差 -0.348円

「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