

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/1/27(水) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	27日需給速報		28日需給予想	29日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 200	▲ 800	▲ 1,000
財政		▲ 600	▲ 3,900	▲ 3,800
資金過不足		▲ 800	▲ 4,700	▲ 4,800
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
62,714				
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		5,100		12,600
CP等買入				3,500
		▲ 100	▲ 300	
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			▲ 100	
ETF買入		200	300	
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		5,100	0	16,100
当預増減		4,300	▲ 4,700	11,300

<< 1/28の日銀調節とレート予想 >>

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,582,700	前日比	▲ 4,700
O/N	0.07~0.08	T/N	0.03~0.12	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。

<< 27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4,000億円増加の193兆3,000億円(当座預金残高見込みは259兆円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.073%、地銀・信託業態から0.073~0.075%近辺の調達希望。朝方は0.075%近辺の出合いが中心。一巡後は0.07~0.075%のレンジでの出合いが見られた。午後には、一部の先から試し取りの0.125%の調達が見られた。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<< 27日のオープン市場動向 >>

現先S/N物は月末要因から小幅低下。短国市場は、売り物が少ない中、3M物で▲0.040%、1Y物で▲0.100%と強めの出合いが見られた。CP市場は、月末発行に係る取引となり、幅広い業態から大型の発行案件が見られ、発行総額は8,500億円程度となった。発行レートは概ね横ばいの動きとなったが、3月末越えのターム物では一部強めの結果が見られた。

<< 28日の材料 >>

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、29日まで)
- *12月の商業動態統計速報
- *米国12月の耐久財新規受注
- *英国10-12月期のGDP速報値
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、2/1発行)
- *2年利付国債入札(25,000億円、2/15発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、2/9借入)

当座預金残高	2,587,400	1/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,377,200		47,900
積み終了先	1,925,100	1/28以降の残り所要積立額	
超過準備	1,925,000	積数	41,500
非準備先残高	210,200	1日平均	2,200
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			2,055,700
準備預金進捗率	97.98% (実績)		38.71% (日数)

JGB新発10年債	0.210	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	17,163.92	455.02	為替(9時)	118.37-40
						為替(5時)	118.24-26

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	1/20	1/21	1/22	1/25	1/26	1/27
日銀当預残	2,561,800	2,538,100	2,546,400	2,543,500	2,583,100	2,587,400
準備預金残	2,345,500	2,327,100	2,333,000	2,328,500	2,364,400	2,377,200
レート	0.074%	0.075%	0.075%	0.075%	0.079%	0.076%
月中平均	0.06950%	0.06976%	0.07042%	0.07060%	0.07092%	0.07111%

1/26のマナタリーベース				3,576,600
1/26コール	合計	231,665	無担	87,613
			有担	144,052
コール前日増減	計	▲ 907	無担	▲ 348
			有担	▲ 559

1/27の加重平均レート(速報)				1/26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 ~0.125 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)				0.055 ~0.125 (0.079)		0.073 ~0.121 (0.079)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.121 (0.083)									
0.030 (0.030)									
0.097 ~0.130 (0.112)								0.098 ~0.130 (0.109)	
								0.114 ~0.310 (0.134)	
				0.07-0.12	-				
				0.07-0.11	-				
				0.07-0.11	▲0.040			0.080 (0.080)	
				-	-				
				-	▲0.100				
									有担先日付分

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	8,611億円	1/27	~ 1/28 (1日間)	応札	44億円	落札	44億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債補完	1,654億円	1/27	~ 1/28 (1日間)	応札	11億円	落札	11億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	4,000億円	1/29		応札	14,006億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	-0.003%	43.5%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	4,200億円	1/29		応札	14,058億円	落札	4,208億円	按分利回り較差	-0.003%	51.3%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	2,600億円	1/29		応札	7,129億円	落札	2,611億円	按分利回り較差	-0.013%	29.1%	平均利回り較差	-0.009%
国債買入	1,800億円	1/29		応札	5,063億円	落札	1,802億円	按分利回り較差	-0.027%	56.7%	平均利回り較差	-0.022%
預保借入(金融再生勘定・金融機能強化)	915億円	2/5 ~ 2017/2/3		応札	5,305億円	落札	915億円	0.077%	按分	72.678%	平均	0.076%

「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