

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/2/5(金)

《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		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	1,400	0
財政		2,600	▲ 10,800	1,000
資金過不足		2,700	▲ 9,400	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
62,564			▲ 1,700	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				10,000
国庫短期証売却				
国債買入		9,700		12,700
CP等買入		▲ 700	▲ 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		▲ 100		
ETF買入		200		
国債補完供給		200		
小計		9,300	▲ 1,800	22,700
当預増減		12,000	▲ 11,200	23,700

《 2/8の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,522,600	前日比	▲ 11,200
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは、0.05~0.07%のレンジ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1兆4,000億円増加の185兆9,000億円(当座預金残高見込みは253兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、系統・地銀業態などから0.07%の調達希望で始まった。週末要因からか取り上がりとなり、立ち上がりは0.065~0.075%のレンジでの出合い。一巡後は0.05%台の出合いが中心であった。ターム物は証券業態のロール案件が見られる程度であった。

《 5日のオープン市場動向 》
 現先レートは横ばい圏で推移。アウトライト市場は短国買入オペが10,000億円実施された。今後の先行きが不透明な中、一旦利食いの動きがでたためか、平均利回較差+0.017%、按分利回較差+0.010%という結果になった。オペ後は3M物が▲0.17%~▲0.155%、1Y物が▲0.257%の出合いとなった。CP市場は商社、ノンバンク業態でまとまった発行が見られ、発行総額は1,200億円程度に達した。発行レートは引き続き低位で推移した。3,500億円で実施されたCP等買入オペは、応札可能な銘柄が多かったものの、平均0.009%、按分0.001%と前回オペ(平均0.074%、按分0.070%)比で大幅に低下した。

《 8日の材料 》
 *金融政策決定会合における主な意見(1月28・29日分)
 *12月の国際収支 *12月の毎月勤労統計調査速報
 *12月の特定サービス産業動態統計速報
 *1月の景気ウォッチャー調査
 *米国1月のFRB労働市場情勢指数
 *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、2/10発行)

当座預金残高	2,533,800	2/5以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,290,600		11,300
積み終了先	1,849,000	2/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,849,000	積数	6,200
非準備先残高	243,200	1日平均	800
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	2,060,000		
準備預金進捗率	99.70% (実績)		74.19% (日数)

JGB新発10年債	0.025	▲ 0.029	日経平均株価(終値)	16,819.59	▲ 225.40	為替(9時)	116.85-87
						為替(5時)	116.81-83

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	1/29	2/1	2/2	2/3	2/4	2/5
日銀当預残	2,593,000	2,589,400	2,571,800	2,538,300	2,521,800	2,533,800
準備預金残	2,366,300	2,356,600	2,332,000	2,298,300	2,282,900	2,290,600
レート	0.066%	0.058%	0.061%	0.064%	0.066%	0.068%
月中平均	0.07071%	0.05800%	0.05950%	0.06100%	0.06225%	0.06471%

2/4のマネタリーベース				3,512,400			
2/4コール	合計	216,797	無担	92,115	有担	124,682	
コール前日増減	計	▲ 348	無担	▲ 222	有担	▲ 126	

2/5の加重平均レート(速報)				2/4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	
0.040 ~0.125 (0.068)	0.030	~0.040 (0.031)				0.030	~0.075 (0.066)	0.030	~0.040 (0.031)
0.050 ~0.130 (0.074)								0.050	~0.121 (0.071)
0.070 (0.070)								0.070	(0.070)
0.070 ~0.150 (0.099)								0.050	~0.150 (0.073)
0.150 ~0.320 (0.178)								0.140	(0.140)
0.180 (0.180)				0.01-0.10	-			0.120	~0.130 (0.125)
				0.01-0.10	-				
				0.01-0.10	▲0.17-▲0.155				
				-	-				
				-	▲0.257				

《オペ情報、入札結果》

国債補完	4,000億円	2/5	~ 2/8 (3日間)	応札	17億円	落札	17億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	10,000億円	2/9		応札	25,812億円	落札	10,000億円	按分利回り較差	0.010%	95.0%	平均利回り較差	0.017%
国債買入	4,000億円	2/9		応札	10,632億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	-0.015%	68.0%	平均利回り較差	-0.009%
国債買入	4,200億円	2/9		応札	12,796億円	落札	4,202億円	按分利回り較差	-0.028%	97.4%	平均利回り較差	-0.025%
国債買入	4,500億円	2/9		応札	16,539億円	落札	4,507億円	按分利回り較差	-0.012%	79.7%	平均利回り較差	-0.011%
CP買入	3,500億円	2/10		応札	6,252億円	落札	3,494億円	按分レート	0.001%	51.3%	平均落札レート	0.009%
ETF買入	330億円	約定日	2/5									

「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