CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/2/9(火) ≪セントラル短資株式会社≫

《咨全重经》

単位 倍四

《貝立而和			単位 退円
	9日需給速報	10日需給予想	12日当社予想
	即日金額	金額	金額
銀行券	200	4 00	0
財政	1,600	▲ 28,800	1 2,000
資金過不足	1,800	▲ 29,200	1 2,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)			
60,881			
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	13,000		
CP等買入		3,500	
	▲ 100	▲ 500	
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			
ETF買入			
国債補完供給			
小計	22,900	3,000	0
当預増減	24,700	▲ 26,200	1 2,000
	= :,: 00		: _,: 30

«	2/10の日銀	調節とレー	ト予想	>				
日銀調節	見送り	当座預金列	浅高	2,520,8	00	前日比	``	1 26,200
O/N	0.05~0.07	T/N	0.0	~ 0.12	(J	$N \setminus S$	(0.05~0.12
無担O/Nは る。	₹、0.05~0.07	′%のレンシ	での	出合いが	中心	になると	: 見	込まれ

9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2兆4,000億円増加の186兆 8,000億円(当座預金残高見込みは255兆円)。朝方の無担〇/Nは、系統・信 託・地銀業態などから0.065%~0.07%近辺の調達希望で始まり0.075%の出 合いが中心。一巡後は0.05%台の出合いであった。本日も一部の地銀業態よ り試し取りの動きが散見された。ターム物は引き続き閑散とした取引であっ た。

9日のオープン市場動向 ≫

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。短国市場は様子見の姿勢が 強く、閑散とした地合い。6M物で▲0.175%での少額の出合いが見られた程 度であった。CP市場は、総額2,000億円強の償還に対して、1,000億円強の 発行があり、償還超となった。商社等からはまとまった発行が見られた。発 行レートは引き続き低位での推移となった。

日経平均株価(終値)

16,085.44 🔺 918.86

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

為替(9時) 115.64-67

為替(5時) 115.30-31

10日の材料 >>

- *1月の企業物価指数
- *米国1月の財政収支

JGB新発10年債

-0.029 ▲ 0.064

*国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、2/15発行)

当座預金残高	2,547,000	2/9以降の	残り所要積立額
準備預金残高	2,302,100		4,000
積み終了先	1,864,500	2/10以降の)残り所要積立額
超過準備	1,864,000	積数	2,700
非準預先残高	244,900	1日平均	400
積み期間(1/10	3~2/15)の所	·要準備額(積	数) 2,060,000
準備預金進捗	率 99.87%	(実績)	80.65% (日数)

積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数) 2,060,000				日付	2/2	2/3	2/4	2/5	2/8	2/9
準備預金進捗率	99.87% (実	漬) 80.65%	(日数)	日銀当預残	2,571,800	2,538,300	2,521,800	2,533,800	2,522,300	2,547,000
2/8のマネタリーベース 3,511,500		準備預金残	2,332,000	2,298,300	2,282,900	2,290,600	2,274,700	2,302,100		
2/8コール 合計	203,517 無担	87,502 有担	116,015	レート	0.061%	0.064%	0.066%	0.068%	0.072%	0.073%
コール前日増減 計	5,371 無担	7,081 有担	▲ 1,710	月中平均	0.05950%	0.06100%	0.06225%	0.06471%	0.06563%	0.06644%

2/9 の加重平均レート(速報)					2/8 の加重平均レート(確報) 単			
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	
0.040 ~0.125 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.025 ~0.125 (0.072)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.125 (0.079)				T/N		0.050 ~0.121 (0.068)		
0.120 (0.120)				S/N				
0.062 ~0.120 (0.078)				1W		0.065 ~0.079 (0.076)		
0.150 ~0.280 (0.172)				2W				
				3W				
0.110 ~0.150 (0.130)		0.01-0.10	_	1M			有担先日付分	
		0.01-0.10	_	2M				
		0.01-0.10	_	ЗМ				
		-	▲0.175	6M				
		-	_	1Y				

≪オペ情報、入札結果≫

国債補完 ~ 2/10 (1日間)応札 8億円 落札 8億円 -0.400% 全 取 平均 -0.400% (即) 8,000億円 2/9 30年利付国債(表面利率1.4%) 応札2兆2,112億円 落札7,264億円(I非競争入札:732億円) 2/12~2045/12/20 1.083% 按分61.3545% 平均1.068% ETF買入 330億円 約定日 2/9 J-REIT買入 12億円 約定日 2/9

「「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