

2016/2/9(火) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	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	▲ 400	0
財政	1,600	▲ 28,800	▲ 12,000
資金過不足	1,800	▲ 29,200	▲ 12,000
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	▲ 12,000

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
非準備先残高	244,900	1日平均	400
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	99.87% (実績)	80.65% (日数)	

2/8のマネタリーベース	3,511,500
2/8コール 合計	203,517 無担 87,502 有担 116,015
コール前日増減 計	5,371 無担 7,081 有担 ▲ 1,710

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			
0.040 ～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	-		3M					
		-	▲0.175		6M					
		-	-		1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 8,000億円 2/9 ～ 2/10 (1日間) 応札 8億円 落札 8億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

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