

2016/2/12(金) <セントラル短資株式会社>

<<資金需給>>

単位 億円

	12日需給速報		15日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		0	800	0
財政		▲ 7,700	47,200	▲ 5,000
資金過不足		▲ 7,700	48,000	▲ 5,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
60,881			▲ 1,100	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				17,500
国庫短期証売却				
国債買入			9,700	
CP等買入				
		▲ 800	▲ 600	
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	即日	▲ 200	200	
小計		▲ 1,000	8,200	17,500
当預増減		▲ 8,700	56,200	12,500

当座預金残高	2,511,000	2/12以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,273,000		1,400
積み終了先	1,835,300	2/15以降の残り所要積立額	
超過準備	1,835,300	積数	600
非準備先残高	238,000	1日平均	600
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	99.97% (実績)	96.77% (日数)	

2/10のマネタリーベース	3,509,100
2/10コール合計	175,289無担 74,360有担 100,929
コール前日増減	計 ▲ 12,682無担 ▲ 9,206有担 ▲ 3,476

2/12の加重平均レート(速報)				2/10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		
0.010 ~0.125 (0.071)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.015 ~0.125 (0.072)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.050 ~0.121 (0.075)					0.050 ~0.121 (0.075)			
0.001 ~0.120 (0.007)					0.100 ~0.122 (0.111)			
0.080 ~0.150 (0.124)					0.030 (0.030)			
0.001 (0.001)					0.125 (0.125)			
0.001 ~0.150 (0.011)								
0.000 ~0.150 (0.085)		0.01-0.10	-	1M	0.001 (0.001)	0.001 ~0.115 (0.014)	有担先日付分	
		0.01-0.10	-	2M				
		0.01-0.10	▲0.11-▲0.10	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 22,392億円 2/12 ~ 2/15 (3日間) 応札 145億円 落札 145億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

国短買入 17,500億円 2/16 応札 46,778億円 落札 17,502億円 按分利回り較差 0.015% 57.3% 平均利回り較差 0.028%

流動性供給 応札 1兆4,351億円 落札 4,996億円 2/16 募入最大利回り較差 0.015% 按分 68.1528% 募入平均利回り較差 0.007%

ETF買入 330億円 約定日 2/12

J-REIT買入 12億円 約定日 2/12

「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

<< 2/15の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,567,200	前日比	56,200
O/N	0.04~0.075	T/N	0.001~0.12	S/N	0.001~0.12
無担O/Nは、0.04~0.075%のレンジでの出合いが中心になると見込まれる。					

<< 12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1兆円減少の183兆8,000億円(当座預金残高見込みは251兆4,000億円)。朝方の無担O/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0.07~0.075%の出合いが中心。一巡後は0.04~0.06%台まで取り下がる動きが見られつつ、本日の取引を終えた。マイナス金利が適用開始となる16日にあたるS/Nは0.001%の出合いが見られ、ターム物も1W~3Wで0.001%の出合いが散見された。

<< 12日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは16日からのマイナス金利導入の影響を受け、弱含みな推移となった。短国市場は、短国買入オペが1兆7,500億円の規模でオファーされた。結果は、平均落札利回り較差+0.028%、按分利回り較差+0.015%の決着となった。セカンダリーは3M物で▲0.11~▲0.10%での出合いが見られた。CP市場は、償還が少額であったこともあり、発行総額600億円弱と、さほど膨らまなかった。発行レートは概ね横ばい圏で推移し、引き続き長めのタームの物では強めの買いが入りやすい地合いが継続していた。

<< 15日の材料 >>

- *10-12月期のGDP1次速報(市場予測：前期比年率▲1.2%)
- *12月の第3次産業活動指数
- *12月の石油等消費動態統計
- *米国祝日(Presidents' Day)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	112.48-51
0.075 0.070	14,952.61 ▲ 760.78	為替(5時)	112.16-18

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	2/4	2/5	2/8	2/9	2/10	2/12
日銀当預残	2,521,800	2,533,800	2,522,300	2,547,000	2,519,700	2,511,000
準備預金残	2,282,900	2,290,600	2,274,700	2,302,100	2,285,000	2,273,000
レート	0.066%	0.068%	0.072%	0.073%	0.072%	0.071%
月中平均	0.06225%	0.06471%	0.06563%	0.06644%	0.06745%	0.06821%