

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/2/24(水)

◀ セントラル短資株式会社 ▶

## ◀ 資金需給 ▶

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想	26日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,600	▲ 2,300	▲ 2,000
財政		▲ 400	▲ 1,100	3,000
資金過不足		▲ 2,000	▲ 3,400	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
59,239				
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				12,600
CP等買入				
		▲ 300	▲ 900	
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			▲ 600	800
ETF買入			300	
国債補完供給	即日	▲ 600		
		800	600	
小計		▲ 100	▲ 600	13,400
当預増減		▲ 2,100	▲ 4,000	14,400

◀ 2/25の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,578,100	前日比	▲ 4,000
O/N	▲0.02~0.001	T/N	▲0.02~0.001	S/N	▲0.02~0.001

無担O/Nは、0%前後での出合いが中心になると見込まれる。

### ◀ 24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4,000億円減の190兆6,000億円(当座預金残高見込みは258兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.01%オファーに対し、▲0.03%ビッドで始まった。その後は国内勢により▲0.01~0.001%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後は、0%での出合いが数件見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

### ◀ 24日のオープン市場動向 ▶

現先レートS/Nは、低水準での推移が継続していた。短国市場は引き続き閑散であったが、3M物の▲0.12~▲0.11%である程度まとまった出合いが見られた。CP市場は、償還総額800億程度に対し、発行総額は2,100億円程度と活況であった。発行量は膨らんでいたものの、投資家の買いニーズが強く、発行レートは低下基調であった。CP等買入オペアは、前回比500億円増額の4,000億円で購入された。応札額は4,789億円、按分利回▲0.298%、平均落札利回▲0.037%と、応札額が少なかったこともあって深いマイナスでの決着となった。

### ◀ 25日の材料 ▶

- \*木内日銀審議委員、鹿児島県金融経済懇談会にて講演
- \*月例経済報告
- \*米国1月の耐久財新規受注
- \*英国10-12月期のGDP改定値
- \*ユーロ圏1月の消費者物価指数改定値
- \*国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、2/29発行)
- \*2年利付国債入札(25,000億円、3/15発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、3/4借入)

当座預金残高	2,582,100	2/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,351,700		41,200
積み終了先	1,896,800	2/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,896,500	積数	32,200
非準備先残高	230,400	1日平均	1,600
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)			1,900,000
準備預金進捗率	98.31%	(実績)	31.03% (日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	111.90-92
-0.055 ▲ 0.050	15,915.79 ▲ 136.26	為替(5時)	112.11-13

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	2/17	2/18	2/19	2/22	2/23	2/24
日銀当預残	2,593,700	2,582,400	2,593,100	2,550,900	2,584,200	2,582,100
準備預金残	2,369,400	2,355,700	2,355,200	2,320,500	2,350,100	2,351,700
レート	-0.002%	-0.009%	-0.008%	-0.001%	-0.001%	-0.003%
月中平均	0.06047%	0.05661%	0.04738%	0.04518%	0.04317%	0.04125%

2/23のマナタリベース				3,576,300
2/23コール	合計	49,139無担	32,381有担	16,758
コール前日増減	計	2,211無担	2,428有担	▲ 217

2/24の加重平均レート(速報)				2/23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		有担当日分
▲0.05 ~ 0.001 (▲0.003)	0.001	(0.001)				O/N	▲0.01 ~ 0.010 (▲0.001)	0.001 (0.001)
▲0.01 ~ 0.000 (▲0.005)						T/N		
						S/N	▲0.01 ~ 0.000 (▲0.005)	
0.001 (0.001)						1W	▲0.02 (▲0.020)	0.000 (0.000)
▲0.02 ~ 0.280 (0.007)						2W		0.000 (0.000)
						3W		
				0.001-0.10	-	1M		0.001 (0.001)
				0.001-0.10	-	2M		
				0.001-0.10	▲0.11-▲0.15	3M		
				-	-	6M		
				-	▲0.375	1Y		

## ◀ オペ情報、入札結果 ▶

国債補完	23,172億円	2/24	~ 2/25 (1日間)	応札	473億円	落札	473億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
国債補完	8,382億円	2/24	~ 2/25 (1日間)	応札	45億円	落札	45億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
国債買入	4,000億円	2/26		応札	10,968億円	落札	4,001億円	0.001%	12.6%	平均利回り較差	0.010%
国債買入	4,200億円	2/26		応札	12,813億円	落札	4,202億円	0.001%	38.6%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,600億円	2/26		応札	5,960億円	落札	2,602億円	-0.002%	80.5%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	1,800億円	2/26		応札	3,119億円	落札	1,801億円	-0.011%	26.3%	平均利回り較差	0.002%
CP買入	4,000億円	2/29		応札	4,789億円	落札	4,000億円	-0.298%	35.0%	平均落札レート	-0.037%

「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