

2016/2/25(木)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	25日需給速報 即日 金額	26日需給予想 金額	29日当社予想 金額
銀行券	▲ 2,300	▲ 1,800	▲ 900
財政	▲ 4,000	800	6,500
資金過不足	▲ 6,300	▲ 1,000	5,600
貸出			
売出手形 0			
本店共通 0			
全店共通 0			
共通(固定) 59,239			700 ▲ 1,300
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		13,400	
CP等買入	▲ 900	▲ 400	4,000
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	▲ 200 800	
ETF買入	300	100	
国債補完供給 即日	600 ▲ 100	100	
小計	▲ 700	13,800	3,400
当預増減	▲ 7,000	12,800	9,000

当座預金残高	2,575,100	2/25以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,341,200		32,200
積み終了先	1,886,600	2/26以降の残り所要積立額	
超過準備	1,886,400	積数	23,800
非準備先残高	233,900	1日平均	1,300
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	98.75%	(実績)	34.48% (日数)

2/24のマネタリーベース	3,575,800
2/24コール 合計	48,766 無担 32,311 有担 16,455
コール前日増減 計	▲ 373 無担 ▲ 70 有担 ▲ 303

2/25 の加重平均レート(速報)				2/24 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	有担先日付分	
▲0.04 ~0.001 (▲0.003)	0.001 (0.001)			▲0.05 ~0.001 (▲0.003)	▲0.01 ~0.000 (▲0.005)	0.001 (0.001)	0.001 (0.001)	
0.000 (0.000)				T/N				
				S/N				
▲0.01 (▲0.010)				1W	0.001 (0.001)			
0.000 (0.000)				2W	▲0.02 ~0.280 (0.007)			
				3W				
		0.001-0.10	-	1M	0.001 (0.001)	有担先日付分		
		0.001-0.10	-	2M				
		0.001-0.10	▲0.1002-▲0.08	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.382	1Y				

《オペ情報、入札結果》

全店共通 8,000億円 2/29 ~ 5/30 (91日間) 応札 740億円 落札 740億円 0.000% 全取 平均 0.000% (固定)
 国債補完 10,951億円 2/25 ~ 2/26 (1日間) 応札 57億円 落札 57億円 -0.500% 全取 平均 -0.500% (即)
 T-Bill3M 応札15兆666億円 落札4兆1,392億4,000万円(非競争入札:3,907億円) 2/29~5/30 ▲0.1002% 按分59.2670% 平均▲0.1066%
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札9兆8,889億円 落札2兆2,764億円(I 非競争入札:2,233億円) 3/15~2018/3/15 ▲0.176% 按分92.0868% 平均▲0.183%
 交付税特会 1兆500億円 3/4~9/2 応札8兆8,982億円 落札1兆500億400万円 0.001% 按分12.5028% 平均0.001%

2/26の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,587,900	前日比	12,800
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。					

《 25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5,000億円減の190兆1,000億円(当座預金残高見込みは257兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.01%オファーに対し、▲0.02%ビッドで始まった。その後、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、閑散とした状況のなか本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで0%の出合いが見られた。共通担保資金供給オペは、3M物で8,000億円オファーされ、応札額740億円(期落ち額1,310億円)で札割れとなった。

《 25日のオープン市場動向 》

現先S/N物は低位横ばい圏で推移した。短国市場は3M物の入札が実施された。入札結果は平均落札利回▲0.1066%、按分落札利回▲0.1002%と、事前予想通りの慎重な入札結果となった。C/P市場は月末発行に当たり、幅広い業態で発行が実施された。発行総額は7,700億円程度まで膨らんだものの、償還総額1兆1,500円には届かず、償還超のマーケットとなった。発行レートは極めて低い水準にあり、a-1格以上の期越物は0%で按分となるケースも散見された。

《 26日の材料 》

*1月全国・2月都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想: 全国(1月)前年同月比(除く生鮮): +0.0%
 東京都区部(2月)前年同月比(除く生鮮): ▲0.2%
 *米国10-12月期のGDP改定値
 *米国1月の個人所得・消費支出

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	112.06-08
-0.065 ▲ 0.010	16,140.34 224.55	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	2/18	2/19	2/22	2/23	2/24	2/25
日銀当預残	2,582,400	2,593,100	2,550,900	2,584,200	2,582,100	2,575,100
準備預金残	2,355,700	2,355,200	2,320,500	2,350,100	2,351,800	2,341,200
レート	-0.009%	-0.008%	-0.001%	-0.001%	-0.003%	-0.003%
月中平均	0.05661%	0.04738%	0.04518%	0.04317%	0.04125%	0.03948%

「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録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