

2016/2/26(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	26日需給速報		29日需給予想	1日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,900	0	0
財政		▲ 1,100	4,600	▲ 15,000
資金過不足		▲ 3,000	4,600	▲ 15,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)			700	
59,239			▲ 1,300	
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証買入				7,500
国庫短期証売却				
国債買入		13,400		5,700
CP等買入			4,000	
		▲ 400	▲ 3,100	
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		800		
		▲ 200		
ETF買入		100	300	
国債補完供給		100		
小計		13,800	600	13,200
当預増減		10,800	5,200	▲ 1,800

《 2/29の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,591,100	前日比	5,200
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。					

《 26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6,000億円減の189兆5,000億円(当座預金残高見込みは258兆8,000億円)。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、0.001%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。

《 26日のオープン市場動向 》

現先S/N物は引続き低位で推移した。短国買入オペアは前回比1兆円減額の7,500億円でオファーされた。大きく減額されたこともあり、平均利回較差+0.026% 按分利回較差+0.021%と小甘い結果となった。出合いは見られず、閑散な地合が続いていた。CP市場は月初の発行となり、発行案件は膨らまず、落ち着いたマーケットとなった。発行総額は、石油・石炭業、小売業、食料品業態からまとまった額の発行が見られ、1,300億円程度となり、償還総額約1,000億円を上回った。発行レートは、a-1格以上の期越物の大部分が0%で決着するなど、引続き極めて低い水準で推移した。

《 29日の材料 》

- *1月の商業動態統計速報
- *1月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比3.3%)
- *1月の住宅着工統計
- *米国2月のシカゴPM景況感指数
- *ユーロ圏2月の消費者物価指数速報値

当座預金残高	2,585,900	2/26以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,334,700		23,800
積み終了先	1,887,600	2/29以降の残り所要積立額	
超過準備	1,883,300	積数	5,700
非準備先残高	251,200	1日平均	400
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,900,500		
準備預金進捗率	99.70% (実績)	44.83% (日数)	

JGB新発10年債	
-0.065	0.000

日経平均株価(終値)	
16,188.41	48.07

為替(9時)	113.13-15
為替(5時)	112.87-89

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	2/19	2/22	2/23	2/24	2/25	2/26
日銀当預残	2,593,100	2,550,900	2,584,200	2,582,100	2,575,100	2,585,900
準備預金残	2,355,200	2,320,500	2,350,100	2,351,800	2,341,200	2,334,700
レート	-0.008%	-0.001%	-0.001%	-0.003%	-0.003%	-0.002%
月中平均	0.04738%	0.04518%	0.04317%	0.04125%	0.03948%	0.03504%

2/25のマネタリーベース		3,571,100	
2/25コール 合計	45,107	無担 28,531	有担 16,576
コール前日増減 計	▲ 3,659	無担 ▲ 3,780	有担 121

2/26の加重平均レート(速報)				2/25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			
▲0.04 ~ 0.001 (▲0.002)	0.001	(0.001)		▲0.04 ~ 0.001 (▲0.003)		0.001	(0.001)		
▲0.005 ~ 0.000 (▲0.004)					0.000	(0.000)			
▲0.01 ~ 0.300 (▲0.002)				1W	▲0.01	(▲0.010)			
				2W	0.000	(0.000)			
				3W					
		0.001-0.10	-	1M				有担先日付分	
		0.001-0.10	-	2M					
		0.001-0.10	-	3M					
		-	-	6M					
		-	-	1Y					

《オペ情報、入札結果》

国債補完	17,375億円	2/26	~ 2/29 (3日間)	応札 15億円	落札 15億円	-0.500%	全取	平均 -0.500% (即)
国短買入	7,500億円	3/1	応札 31,895億円	落札 7,501億円	按分利回り較差	0.021%	73.6%	平均利回り較差 0.026%
国債買入	4,500億円	3/1	応札 8,717億円	落札 4,503億円	按分利回り較差	-0.009%	38.6%	平均利回り較差 -0.002%
国債買入	1,200億円	3/1	応札 1,456億円	落札 1,200億円	按分利回り較差	1.350円	60.5%	平均利回り較差 0.538円

「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