

2015/2/4(水)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想	6日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,100	300	▲ 1,000
財政		▲ 27,900	▲ 16,100	1,000
資金過不足		▲ 26,800	▲ 15,800	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				13,600
75,199				▲ 10,000
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		4,900		12,000
CP等買入				
		▲ 100	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789				
被災地支援				
3,252				
社債等買入				
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		4,900	▲ 300	15,600
当預増減		▲ 21,900	▲ 16,100	15,600

当座預金残高	1,800,800	2/4以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,630,000		22,800
積み終了先	1,335,200	2/5以降の残り所要積立額	
超過準備	1,335,000	積数	19,000
非準備先残高	170,800	1日平均	1,700
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			1,976,300
準備預金進捗率	99.04%	(実績)	64.52% (日数)

2/3のマネタリーベース		2,756,700	
2/3コール	合計	205,718	無担 82,372 有担 123,346
コール前日増減	計	4,164	無担 3,407 有担 757

2/4 の加重平均レート(速報)				2/3 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		
0.060 ~0.135 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.050 ~0.135 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)		
0.072 ~0.130 (0.078)				T/N		0.071 ~0.123 (0.074)		
				S/N				
0.117 ~0.250 (0.146)				1W		0.117 ~0.120 (0.118)		
0.076 ~0.340 (0.111)				2W		0.118 ~0.310 (0.119)		
				3W				
0.118 ~0.147 (0.122)		0.08-0.12	-	1M		0.118 ~0.630 (0.126)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
0.117 (0.117)		0.08-0.12	▲0.020-▲0.018	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

全店共通	15,000億円	2/6	~ 5/19 (102日間)	応札	13,630億円	落札	13,630億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	4,000億円	2/6	応札	10,852億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	0.007%	1.0%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	4,000億円	2/6	応札	12,282億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	0.005%	49.9%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	2/6	応札	7,617億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.011%	25.3%	平均利回り較差	0.022%
交付税特会	1兆500億円	2/18~8/14	応札	3兆7,360億円	落札	1兆500億円	0.089%	按分80.6454%	平均0.088%		

「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

《 2/5の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,784,700	前日比	▲ 16,100
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.07%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

《 4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1兆6,000億円減少の134兆7,000億円(当座預金残高見込みは180兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.068~0.07%、地銀・信託業態から0.07~0.072%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.072~0.073%を中心とした出合い。地銀業態を中心にやや調達意欲が高く、一巡以降も0.07~0.071%の出合いで底堅く推移した。ターム物は、1W~2Wの期間で大手行によるまとまった調達が確認された。3M物の共通担保オペが15,000億円でオファーされ、落札額13,630億円と札割れになったものの、期落ち額の10,031億円を上回る結果となった。

《 4日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは、小幅低下基調で推移となった。短国アウトライト市場は3M▲0.020~▲0.018%の出合いが見られた。CP市場は閑散で、発行総額は500億円程度にとどまった。発行レートは横ばい圏の推移であった。

《 5日の材料 》

- *MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
- *米国12月の貿易収支
- *国庫短期証券入札(3ヵ月、57,000億円、2/9発行)
- *30年利付国債入札(6,000億円、2/9発行)

《コール1月の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	0.07284%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07389%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	117.65-68
0.380	0.020	17,678.74	342.89
		為替(5時)	117.53-55

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	1/28	1/29	1/30	2/2	2/3	2/4
日銀当預残	1,841,700	1,836,600	1,849,300	1,816,100	1,822,700	1,800,800
準備預金残	1,653,200	1,663,000	1,683,200	1,650,600	1,655,200	1,630,000
レート	0.087%	0.071%	0.071%	0.071%	0.073%	0.075%
月中平均	0.07304%	0.07297%	0.07284%	0.07100%	0.07167%	0.07250%