

<<資金需給>>

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想	12日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		800	300	0
財政		▲ 24,800	▲ 8,700	▲ 1,000
資金過不足		▲ 24,000	▲ 8,400	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,200	3,600	
78,598		▲ 2,400	▲ 4,700	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				25,000
国庫短期証売却				
国債買入			12,300	4,700
CP等買入		▲ 300	▲ 600	
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		300	200	
国債補完供給				
小計		▲ 200	14,800	29,700
当預増減		▲ 24,200	6,400	28,700

当座預金残高	1,772,600	2/9以降の残り所要積立額
準備預金残高	1,612,200	11,400
積み終了先	1,319,500	2/10以降の残り所要積立額
超過準備	1,318,900	積数
非準備先残高	160,400	1日平均
		500
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,986,300	
準備預金進捗率	99.84% (実績)	80.65% (日数)

2/6のマナターベース		2,729,200	
2/6コール	合計	201,427	無担 81,224 有担 120,203
コール前日増減	計	▲ 2,573	無担 ▲ 2,492 有担 ▲ 81

2/9の加重平均レート(速報)				2/6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
0.060 ~0.130 (0.081)	0.030	~0.040 (0.031)				0.030 ~0.080 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.123 (0.078)							0.073 ~0.120 (0.077)	
0.117 (0.117)							0.071 ~0.260 (0.118)	
0.118 ~0.310 (0.173)							0.118 (0.118)	
0.145 (0.145)				0.08-0.12	-		0.150 (0.150)	有担先日付分
				0.08-0.12	-			
				0.08-0.12	▲0.002-0.000			
				-	▲0.010			
				-	▲0.010			

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	25,000億円	2/12	応札	62,955億円	落札	25,001億円	按分利回り較差	0.001%	32.6%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	700億円	2/12	応札	1,850億円	落札	700億円	按分利回り較差	0.004%	99.0%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	2/12	応札	13,052億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	0.017%	87.0%	平均利回り較差	0.020%
預保借入(金融機能強化勘定)	605億円	2/20 ~2016/2/5	応札	3,145億円	落札	605億円	0.089%	按分 50.625%	平均 0.089%		
J-REIT買入	12億円	約定日	2/9								

<< 2/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,779,000	前日比	6,400
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。

<< 9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2兆3,000億円減少の132兆3,000億円(当座預金残高見込みは177兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.068~0.07%、地銀・信託から0.07~0.075%近辺での調達希望で始まった。地銀から試し取りのやや高めの出合いが入った事で強含み、立ち上がりは0.075%近辺の出合いが中心となった。朝方の出合いレートが底上げされた影響で、一巡後もしくは複数の業態から0.075%近辺のビッドが残る堅調な展開になったものの、徐々に取り下がり、後場に掛けては0.07%近辺がベストビッドとなった。ターム物は、1W物の期間で大手行による幅広い調達を確認された。

<< 9日のオープン市場動向 >>
 現先取引S/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は短国買入オペが25,000億円で実施され、平均利回較差+0.005%、按分利回較差+0.001%と概ね市場実勢で決着した。オペ後は3M▲0.001~0.000%、1Y▲0.010%の出合いが見られた。CP発行市場は石油・不動産業態からまとまった発行が見られたものの、件数は少なく、発行総額は1,000億円程度にとどまった。購入姿勢は依然慎重でレート水準に目立った変化はなかった。

<< 10日の材料 >>
 *12月の第3次産業活動指数 *1月のマネーストック
 *米国12月の卸売売上高
 *G20財務省・中央銀行総裁会議(イスタンブール、10日まで)
 *流動性供給入札(3,000億円、2/13発行)

JGB新発10年債	0.355	0.015	日経平均株価(終値)	17,711.93	63.43	為替(9時)	118.95-97
						為替(5時)	118.97-98

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	2/2	2/3	2/4	2/5	2/6	2/9
日銀当預残	1,816,100	1,822,700	1,800,800	1,784,100	1,796,800	1,772,600
準備預金残	1,650,600	1,655,200	1,631,300	1,619,400	1,634,100	1,612,200
レート	0.071%	0.073%	0.075%	0.076%	0.073%	0.081%
月中平均	0.07100%	0.07167%	0.07250%	0.07320%	0.07313%	0.07400%

「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