

2016/1/22(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	22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		▲ 1,000	700	1,000
財政		▲ 400	▲ 2,400	▲ 3,000
資金過不足		▲ 1,400	▲ 1,700	▲ 2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		6,100	3,100	
62,914		▲ 9,100	▲ 3,300	
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		12,800		12,600
CP等買入		▲ 300	▲ 800	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 271,714				
被災地支援		0		
3,144		0		
社債等買入			▲ 400	
ETF買入		100	100	
国債補完供給		100		
小計		9,700	▲ 1,300	37,600
当預増減		8,300	▲ 3,000	35,600

当座預金残高	2,546,400	1/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,332,700		93,000
積み終了先	1,882,400	1/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,878,000	積数	63,200
非準備先残高	213,700	1日平均	2,900
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			2,057,100
準備預金進捗率	96.93%	(実績)	29.03% (日数)

1/21のマナタリーベース		3,531,300
1/21コール 合計	236,967	無担 92,257 有担 144,710
コール前日増減 計	2,322	無担 2,177 有担 145

1/22 の加重平均レート(速報)				1/21 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	
0.060 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.050 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.073 ~0.121 (0.082)				T/N		0.070 ~0.121 (0.081)		
				S/N				
0.130 (0.130)				1W	0.073 (0.073)			
0.070 ~0.340 (0.086)				2W	0.073 (0.073)			
				3W				
		0.07-0.12	-	1M				有担先日付分
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.035	3M				
		-	▲0.11	6M				
		-	▲0.10-▲0.075	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完	8,000億円	1/22	～ 1/25 (3日間) 応札	25億円	落札	25億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	25,000億円	1/26	応札	34,758億円	落札	25,002億円	-0.004%	83.9%	平均利回り較差	0.028%
国債買入	4,000億円	1/26	応札	9,666億円	落札	4,001億円	-0.006%	78.2%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	4,200億円	1/26	応札	11,593億円	落札	4,205億円	0.002%	68.6%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,600億円	1/26	応札	6,729億円	落札	2,607億円	0.000%	10.1%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	1,800億円	1/26	応札	4,315億円	落札	1,801億円	-0.015%	100.0%	平均利回り較差	-0.009%

「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

《 1/25の日銀調節とレート予想 》

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,543,400	前日比	▲ 3,000
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07~0.08%程度での出合いが中心になると見込まれる。

《 22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1兆1,000億円増加の189兆2,000億円(当座預金残高見込みは254兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.073%近辺、地銀・信託業態から0.073~0.076%近辺の調達希望。朝方の出合いは0.074~0.076%近辺。週末要因により調達意欲はやや高めで、一巡後は0.07~0.075%近辺での出合いを中心に推移した。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

《 22日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは横ばい圏で推移。短国市場では、短国買入オペが2兆5,000億円度でオファーされ、結果は、引値の低い特定の銘柄を中心に落札されたとみられるものの、応札額が3兆4,700億円程度にとどまったこともあり、平均利回較差+0.028%に対して按分利回較差は▲0.004%と流れる結果になった。また、短国買入オペの結果を受け、品薄感が強まることを警戒してか、全般的に強含みでの推移となった。C P市場は商社業態からまとまった発行案件がみられ、償還総額400億円程度に対して発行総額は600億円程度となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

《 25日の材料 》

*11月の景気動向指数改訂状況

*12月の貿易統計