

2016/2/10(水) <セントラル短資株式会社>

<資金需給>

単位 億円

	10日需給速報		12日需給予想	15日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	0	1,000
財政		▲ 29,900	▲ 5,400	56,000
資金過不足		▲ 30,300	▲ 5,400	57,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
60,881				▲ 1,100
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				8,900
CP等買入		3,500	▲ 800	
		▲ 500		
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				
ETF買入				
国債補完供給				
小計		3,000	▲ 800	7,800
当預増減		▲ 27,300	▲ 6,200	64,800

< 2/12の日銀調節とレート予想 >

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,513,500	前日比	▲ 6,200
O/N	0.05~0.075	T/N	0.05~0.12	S/N	0.001~0.12

無担O/Nは、0.05~0.075%のレンジでの出合いが中心になると見込まれる。

< 10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2兆円減少の184兆8,000億円(当座預金残高見込みは252兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、系統・信託・地銀業態などから0.065~0.07%近辺の調達希望で始まり0.075%の出合いが中心。一巡後は0.06%台まで取り下がる動きとなって本日の取引を終えた。ターム物は1M物で0.001%の出合いが散見された。3M物の共通担保資金供給オペは、8,000億円でオファーされ、引き続き応札額はゼロであった。

< 10日のオープン市場動向 >

現先レートは低位横ばい圏での推移となった。短国市場は、3M物の入札が実施された。水準感を探る中、W I 取引で▲0.15%の出合いが見られ、入札結果は平均落札利回▲0.1335%、按分落札利回▲0.1102%の結果となった。C P 市場は15日にかかる発行が行われたものの、償還1,500億円程に対して、発行は1,200億円程にとどまり、さほど膨らまなかった。発行レートは概ね横ばい圏での決着となった。

< 12日の材料 >

- *2月のマネタリーサーベイ
- *米国12月の企業在庫
- *米国1月の小売売上高
- *米国2月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- *ユーロ圏10-12月期のGDP速報値
- *流動性供給入札(5,000億円、2/16発行)

当座預金残高	2,519,700	2/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,284,300		2,700
積み終了先	1,846,700	2/12以降の残り所要積立額	
超過準備	1,846,700	積数	1,400
非準預先残高	235,400	1日平均	300
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	2,060,000		
準備預金進捗率	99.93%	(実績)	87.10% (日数)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	115.17-20
0.005	0.034	15,713.39	▲ 372.05	為替(5時)	114.88-89

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	2/3	2/4	2/5	2/8	2/9	2/10
日銀当預残	2,538,300	2,521,800	2,533,800	2,522,300	2,547,000	2,519,700
準備預金残	2,298,300	2,282,900	2,290,600	2,274,700	2,302,100	2,284,300
レート	0.064%	0.066%	0.068%	0.072%	0.073%	0.072%
月中平均	0.06100%	0.06225%	0.06471%	0.06563%	0.06644%	0.06745%

2/9のマネタリーベース	3,536,000
2/9コール 合計	187,971 無担 83,566 有担 104,405
コール前日増減 計	▲ 15,546 無担 ▲ 3,936 有担 ▲ 11,610

2/10の加重平均レート(速報)				2/9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	
0.015 ~0.125 (0.072)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.040 ~0.125 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.121 (0.076)				T/N		0.050 ~0.125 (0.078)		
0.100 ~0.122 (0.111)				S/N		0.120 (0.120)		
0.030 (0.030)				1W	0.062 (0.062)	0.040 ~0.120 (0.051)		
0.125 (0.125)				2W		0.150 ~0.280 (0.172)		
				3W				
0.001 ~0.115 (0.020)		0.01-0.10	-	1M		0.001 ~0.150 (0.066)	有担先日付分	
		0.01-0.10	-	2M				
		0.01-0.10	▲0.15	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<オペ情報、入札結果>

全店共通	8,000億円	2/15 ~ 5/16 (91日間)	0億円	0億円	0.100%	按分	平均	(固定)
国債買入	4,500億円	2/15 応札 14,731億円 落札	4,500億円	按分利回り較差	0.004%	11.1%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	2,600億円	2/15 応札 6,164億円 落札	2,605億円	按分利回り較差	-0.011%	34.9%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	1,800億円	2/15 応札 5,324億円 落札	1,803億円	按分利回り較差	-0.004%	38.2%	平均利回り較差	0.001%
米ドル資金供給(固定金利方式)	2/12~2/19 (7日間)	応札なし	貸付利率 0.880%					
T-Bill3M	応札15兆1,815億1,000万円	落札4兆659億1,000万円(非競争入札:3,840億円)	2/15~5/16 ▲0.1102%	按分55.5978%	平均▲0.1335%			
ETF買入	330億円	約定日 2/10						
J-REIT買入	12億円	約定日 2/10						

「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