

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/2/19(金) <<セントラル短資株式会社>>

## <<資金需給>>

単位 億円

|                                       | 19日需給速報 |         | 22日需給予想 |          | 23日当社予想 |         |
|---------------------------------------|---------|---------|---------|----------|---------|---------|
|                                       | 即日      | 金額      | 金額      | 金額       | 金額      | 金額      |
| 銀行券                                   |         | ▲ 1,100 |         | 300      |         | ▲ 1,000 |
| 財政                                    |         | 2,500   |         | ▲ 41,600 |         | 2,000   |
| 資金過不足                                 |         | 1,400   |         | ▲ 41,300 |         | 1,000   |
| 貸出                                    |         |         |         |          |         |         |
| 売出手形                                  |         |         |         |          |         |         |
| 0                                     |         |         |         |          |         |         |
| 本店共通                                  |         |         |         |          |         |         |
| 0                                     |         |         |         |          |         |         |
| 全店共通                                  |         |         |         |          |         |         |
| 0                                     |         |         |         |          |         |         |
| 共通(固定)                                |         |         |         | 2,300    |         |         |
| 59,740                                |         |         |         | ▲ 2,800  |         |         |
| 国債買現                                  |         |         |         |          |         |         |
| 0                                     |         |         |         |          |         |         |
| CP買現                                  |         |         |         |          |         |         |
| 0                                     |         |         |         |          |         |         |
| 国庫短期証買入                               |         |         |         |          |         | 17,500  |
| 国庫短期証売却                               |         |         |         |          |         |         |
| 国債買入                                  |         | 5,700   |         |          |         | 12,700  |
| CP等買入                                 |         | 3,500   |         |          |         |         |
|                                       |         | ▲ 600   |         | ▲ 300    |         |         |
| 貸出支援基金<br>(成長) 58,484<br>(増加) 271,714 |         |         |         |          |         |         |
| 被災地支援                                 |         |         |         |          |         |         |
| 3,144                                 |         |         |         |          |         |         |
| 社債等買入                                 |         |         |         |          |         |         |
| ETF買入                                 |         | 800     |         |          |         |         |
| 国債補完供給                                | 即日      | ▲ 500   |         | 500      |         |         |
|                                       |         | 400     |         |          |         |         |
| 当増増減                                  |         | 10,700  |         | ▲ 41,600 |         | 31,200  |

| << 2/22の日銀調節とレート予想 >> |              |        |              |     |              |
|-----------------------|--------------|--------|--------------|-----|--------------|
| 日銀調節                  | 見送り          | 当座預金残高 | 2,551,500    | 前日比 | ▲ 41,600     |
| O/N                   | ▲ 0.02~0.001 | T/N    | ▲ 0.02~0.001 | S/N | ▲ 0.02~0.001 |

無担O/Nは、マイナス金利での出合いが中心になると見込まれる。

### << 19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4,000億円増の191兆3,000億円(当座預金残高見込みは259兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.005~0.001%でのオファーに対し、国内勢からの▲0.01%ビッドで始まった。その後、複数の国内勢より▲0.005~0.001%での調達が見られた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

### << 19日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは弱含みでの推移となった。短国市場では、短国買入オペが1兆7,500億円でオファーされ、結果は、平均落札利回較差+0.037%、按分落札利回較差+0.020%となり、引値の低い特定の銘柄が中心に応札されたと考えられる結果となった。セカンダリーでは1Y物で▲0.35%、3M物で▲0.108%の出合いが見られた程度であった。CP市場は、償還額1,400億円程度に対して発行額は400億円程度と、閑散とした地合いであった。発行レートは概ね低位横ばい圏で推移した。

### << 22日の材料 >>

\*特にありません

### << コール1月積み期間分の加重平均レート >>

|         |    |          |    |          |
|---------|----|----------|----|----------|
| (土日を含む) | 無担 | 0.07113% | 有担 | 0.03100% |
| (営業日のみ) | 無担 | 0.07115% | 有担 | 0.03100% |

|                           |             |                |             |
|---------------------------|-------------|----------------|-------------|
| 当座預金残高                    | 2,593,100   | 2/19以降の残り所要積立額 |             |
| 準備預金残高                    | 2,355,200   |                | 136,200     |
| 積み終了先                     | 1,897,300   | 2/22以降の残り所要積立額 |             |
| 超過準備                      | 1,884,000   | 積数             | 57,800      |
| 非準備先残高                    | 237,900     | 1日平均           | 2,500       |
| 積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数) | 1,900,000   |                |             |
| 準備預金進捗率                   | 96.96% (実績) |                | 20.69% (日数) |

|           |       |         |            |           |          |        |           |
|-----------|-------|---------|------------|-----------|----------|--------|-----------|
| JGB新発10年債 | 0.005 | ▲ 0.010 | 日経平均株価(終値) | 15,967.17 | ▲ 229.63 | 為替(9時) | 113.27-29 |
|           |       |         |            |           |          | 為替(5時) | 112.95-96 |

| 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                             | 2/12      | 2/15      | 2/16      | 2/17      | 2/18      | 2/19      |
| 日銀当預残                          | 2,511,000 | 2,564,600 | 2,583,200 | 2,593,700 | 2,582,400 | 2,593,100 |
| 準備預金残                          | 2,273,000 | 2,332,700 | 2,353,400 | 2,369,400 | 2,355,700 | 2,355,200 |
| レート                            | 0.071%    | 0.074%    | 0.001%    | -0.002%   | -0.009%   | -0.008%   |
| 月中平均                           | 0.06821%  | 0.06860%  | 0.06438%  | 0.06047%  | 0.05661%  | 0.04738%  |

| 2/18のマナタリーベース |    |        |    | 3,572,100 |    |        |
|---------------|----|--------|----|-----------|----|--------|
| 2/18コール       | 合計 | 48,029 | 無担 | 28,658    | 有担 | 19,371 |
| コール前日増減       | 計  | 1,322  | 無担 | 968       | 有担 | 354    |

| 2/19の加重平均レート(速報)       |  |               |  | 2/18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         |  |
| ▲0.04 ~0.001 (▲0.008)  |  | 0.001 (0.001) |  |                  |        | ▲0.04 ~0.001 (▲0.009) |  | 0.001 (0.001) |  |
| ▲0.005 ~0.000 (▲0.003) |  |               |  |                  |        | 0.000 ~0.001 (0.000)  |  |               |  |
| ▲0.01 ~0.300 (0.006)   |  |               |  |                  |        | ▲0.001 ~0.310 (0.005) |  |               |  |
| 0.010 (0.010)          |  |               |  |                  |        | 0.120 (0.120)         |  |               |  |
|                        |  |               |  | 0.001-0.10       | -      | 0.001 ~0.250 (0.043)  |  | 有担先日付分        |  |
|                        |  |               |  | 0.001-0.10       | -      |                       |  |               |  |
|                        |  |               |  | 0.001-0.10       | ▲0.108 |                       |  |               |  |
|                        |  |               |  | -                | -      |                       |  |               |  |
|                        |  |               |  | -                | ▲0.350 |                       |  |               |  |

## << オペ情報、入札結果 >>

|       |          |           |              |    |           |    |             |         |            |          |             |
|-------|----------|-----------|--------------|----|-----------|----|-------------|---------|------------|----------|-------------|
| 国債補完  | 7,948億円  | 2/19      | ~ 2/22 (3日間) | 応札 | 447億円     | 落札 | 447億円       | -0.500% | 全取         | 平均       | -0.500% (即) |
| 国短買入  | 17,500億円 | 2/23      |              | 応札 | 55,091億円  | 落札 | 17,502億円    | 0.020%  | 20.4%      | 平均利回り較差  | 0.037%      |
| 国債買入  | 4,000億円  | 2/23      |              | 応札 | 7,821億円   | 落札 | 4,001億円     | -0.036% | 45.3%      | 平均利回り較差  | -0.015%     |
| 国債買入  | 4,200億円  | 2/23      |              | 応札 | 14,999億円  | 落札 | 4,205億円     | -0.015% | 34.7%      | 平均利回り較差  | -0.012%     |
| 国債買入  | 4,500億円  | 2/23      |              | 応札 | 10,997億円  | 落札 | 4,504億円     | -0.023% | 65.6%      | 平均利回り較差  | -0.018%     |
| 交付税特会 | 1兆500億円  | 2/29~8/23 |              | 応札 | 8兆4,989億円 | 落札 | 1兆500億100万円 | 0.001%  | 按分13.2095% | 平均0.001% |             |
| ETF買入 | 330億円    | 約定日       | 2/19         |    |           |    |             |         |            |          |             |

「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