

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/2/23(火)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	23日需給速報		24日需給予想	25日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,200	▲ 1,500	▲ 2,000
財政		4,100	700	▲ 4,000
資金過不足		2,900	▲ 800	▲ 6,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
59,239				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		17,600		
国庫短期証売却				
国債買入		13,100		
CP等買入		▲ 100	▲ 300	
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	即日	▲ 800		
		600	800	
小計		30,400	500	0
当増増減		33,300	▲ 300	▲ 6,000

2/24の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,583,900	前日比	▲ 300
O/N	▲0.02~0.001	T/N	▲0.02~0.001	S/N	▲0.02~0.001
無担O/Nは、0%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

《 23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2兆9,000億円増の191兆円(当座預金残高見込みは258兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.01%オファーに対し、▲0.02%ビッドで始まった。その後、国内勢により▲0.01~0.001%での調達が見られ午前の取引を終えた。午後は、閑散としたなか本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

《 23日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは引続き、低水準で推移した。短国市場は様子見姿勢が継続し、閑散な地合であったが、3M物ではある程度まとまった量の出合いが見られた。CP市場は五・十日発行にあたり、鉄鋼業、小売業、建設業態等で大型の発行案件が散見され、発行総額は3,500億円程度と、償還総額1,500億円程を大きく上回った。発行レートは、運用難を背景とした強い買いが継続しており、全般に低下した。全体のレートが0%付近に収斂してきており、期内物、期越物、格付によるレート差異が縮小する傾向が見られた。

《 24日の材料 》

- *12月の景気動向指数改訂状況
- *1月の企業向けサービス価格指数
- *米国1月の新築一戸建て販売件数
- *米国2月のC B消費者信頼感指数

当座預金残高	2,584,200	2/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,350,100		48,800
積み終了先	1,898,000	2/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,897,700	積数	41,200
非準備先残高	234,100	1日平均	2,000
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	97.83%	(実績)	27.59% (日数)

JGB新発10年債	
-0.005	0.000

日経平均株価(終値)	
16,052.05	▲ 59.00

為替(9時)	112.94-97
為替(5時)	112.13-15

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	2/16	2/17	2/18	2/19	2/22	2/23
日銀当預残	2,583,200	2,593,700	2,582,400	2,593,100	2,550,900	2,584,200
準備預金残	2,353,400	2,369,400	2,355,700	2,355,200	2,320,500	2,350,100
レート	0.001%	-0.002%	-0.009%	-0.008%	-0.001%	-0.001%
月中平均	0.06438%	0.06047%	0.05661%	0.04738%	0.04518%	0.04317%

2/22のマネタリーベース	3,541,800
2/22コール 合計	46,928 無担 29,953 有担 16,975
コール前日増減 計	▲ 991 無担 ▲ 1,052 有担 61

2/23の加重平均レート(速報)				2/22の加重平均レート(確報)			
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
▲0.01 ~0.010 (▲0.001)	0.001 (0.001)			O/N ▲0.01 ~0.010 (▲0.001)		0.001 (0.001)	
▲0.01 ~0.000 (▲0.005)				T/N	▲0.01 ~0.000 (▲0.005)		
				S/N			
▲0.02 ~0.000 (▲0.010)				1W ▲0.02 (▲0.020)	▲0.02 ~0.000 (▲0.007)		
0.000 (0.000)				2W			
				3W			
0.001 (0.001)		0.001-0.10	-	1M		有担先日付分	
		0.001-0.10	-	2M			
		0.001-0.10	▲0.108	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

《オペ情報、入札結果》

国債補完	8,462億円	2/23 ~ 2/24 (1日間)	応札 501億円	落札 501億円	-0.500%	全取	平均 -0.500% (即)
国債補完	23,464億円	2/23 ~ 2/24 (1日間)	応札 215億円	落札 215億円	-0.500%	全取	平均 -0.500% (即)
米ドル資金供給(固定金利方式) 2/25~3/3 (7日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.870%							
40年利付国債(表面利率1.4%) 応札1兆2,212億円 落札3,997億円 2/25~2055/3/20 1.130% 按分28.1632%							
交付税特会 1兆500億円 3/2~8/31 応札 9兆212億円 落札 1兆500億円 0.001% 按分 12.3223% 平均 0.001%							

「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