

<<資金需給>>

単位 億円

	27日需給速報		28日需給予想	31日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,400	▲ 1,700	▲ 300
財政		▲ 1,300	4,100	8,100
資金過不足		▲ 3,700	2,400	7,800
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				1,000
147,384				▲ 6,900
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			9,000	
CP等買入				4,400
		▲ 500	▲ 500	
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512 被災地支援 3,805				
社債等買入				
ETF買入		100	100	
国債補完供給	即日	▲ 200	200	
小計		▲ 600	8,800	▲ 1,500
当預増減		▲ 4,300	11,200	6,300

当座預金残高	1,271,700	3/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,162,000		81,000
積み終了先	969,500	3/28以降の残り所要積立額	
超過準備	964,400	積数	66,000
非準備先残高	109,700	1日平均	3,500
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)			1,870,000
準備預金進捗率	96.47% (実績)	38.71% (日数)	

3/26のマネタリーベース				2,185,300
3/26コール	合計	173,900	無担	59,532
			有担	114,368
コール前日増減	計	▲ 4,707	無担	▲ 3,214
			有担	▲ 1,493

3/27の加重平均レート(速報)				3/26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
0.060 ~0.121 (0.070)	0.040 ~0.050 (0.041)					O/N	0.060 ~0.145 (0.070)	0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.121 (0.078)						T/N		0.065 ~0.120 (0.071)
						S/N		
0.088 (0.088)						1W	0.070 (0.070)	
0.118 (0.118)						2W		
						3W		
0.118 (0.118)				0.08-0.13	-	1M		
				0.08-0.13	0.0200	2M		
0.125 (0.125)				0.08-0.13	0.021-0.030	3M		
				-	-	6M		
				-	0.0225	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	3/31 ~ 6/30 (91日間)	応札	990億円	落札	990億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	4,000億円	3/27 ~ 3/28 (1日間)	応札	166億円	落札	166億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
2年利付国債(表面利率0.1%)	応札16兆3,876億円	落札2兆4,911億円	(I 非競争入札:2,064億円)	4/15~2016/4/15	0.084%	按分	30.7329%	平均	0.082%	
ETF買入	118億円	約定日	3/27							

3/28の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,282,900	前日比	11,200
O/N	0.06~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07%前後の出合いが中心となろう。

<< 27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は、前日比3,000億円増加の976,000億円(当預金残高見込は127兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06~0.065%、信託・証券業態などから0.07%前後での調達希望。立ち上がりは0.07%前後の出合い。昨日に引き続き調達需要は弱く、一巡後は0.065%の出合いを中心に推移した。ターム物では、1W~1M物の期間で大手行によるまとまった調達が確認された。共通担保資金供給オペは、3M物8,000億円のオファーに対して、応札額990億円の札割れとなった。

<< 27日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は低位横ばい圏で推移。短国市場は期末のニーズが強く、堅調に推移。アウトライト市場は2M0.020%、3M0.021~0.030%での出合い。CP市場は償還2兆9,000億円程度に対し発行5,000億円程度。月末発行という事もあり、一部鉄鋼・ノンバンク業態からのまとまった発行案件が見られたが、期末要因により償還額が大幅に上回った。発行レートは投資家のニーズが強く、低位横ばい圏での動き。

- << 28日の材料 >>**
- *2月の完全失業率(市場予想: 3.7%)
 - *2月の有効求人倍率(市場予想: 1.05倍)
 - *2月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比+0.1%)
 - *2月全国・3月都区部消費者物価指数(CPI)
 - 市場予想: 全 国(2月)前年同月比(除く生鮮): +1.3%
 - 東京都区部(3月)前年同月比(除く生鮮): +0.9%
 - *2月の商業販売統計速報
 - *米国2月の個人所得・消費支出

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.91-93
0.630	0.005	為替(5時)	102.10-12
			14,622.89
			145.73

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	3/19	3/20	3/24	3/25	3/26	3/27
日銀当預残	1,166,400	1,235,800	1,217,200	1,244,900	1,276,000	1,271,700
準備預金残	1,052,600	1,122,900	1,106,300	1,127,600	1,161,900	1,162,000
レート	0.077%	0.072%	0.073%	0.069%	0.070%	0.070%
月中平均	0.07416%	0.07378%	0.07375%	0.07356%	0.07342%	0.07330%

「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