

2016/3/1(火)

◀セントラル短資株式会社▶

◀資金需給▶

単位 億円

	1日需給速報		2日需給予想	3日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	100	0
財政		▲ 10,000	▲ 49,000	6,000
資金過不足		▲ 10,100	▲ 48,900	6,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
58,669				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		7,500		
国庫短期証売却				
国債買入		6,000	13,400	
CP等買入		▲ 300	▲ 400	
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		▲ 100		
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 200	200	
小計		12,900	13,200	0
当預増減		2,800	▲ 35,700	6,000

◀ 3/2の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,557,000	前日比	▲ 35,700
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。

◀ 1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、前営業日比1兆2,000億円増の191兆2,000億円(当座預金残高見込みは、259兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.01%のオファーに対し、▲0.02%のビッドで始まった。出合いの水準は▲0.01~0.001%と変化は見られなかったが、積み期間も後半に入ったことで、ビッドサイドの参加者がやや増加した。午後に入ると、0~0.001%での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で0%前後での出合いが散見された。

◀ 1日のオープン市場動向 ▶
 現先レートS/Nは引き続き低水準で推移した。短国市場は材料無く閑散とした中、3M物で▲0.10%の出合いが見られた。CP市場はノンバンク業態で大型発行案件が見られたが、発行件数は少なかった。発行総額は400億円強と、償還総額400億円弱とほぼ同程度にとどまり、閑散なマーケットとなった。発行レートは引き続き極めて低い水準で推移した。

◀ 2日の材料 ▶
 *2月のマネタリーベース
 *2月実績/3月見込み財政資金対民間収支
 *米国ページブック

◀ コール2月の加重平均レート ▶			
(土日を含む)	無担	0.03379%	有担 0.01652%
(営業日のみ)	無担	0.03250%	有担 0.01600%

当座預金残高	2,592,700	3/1以降の残り所要積立額	4,100
準備預金残高	2,336,500	3/2以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,896,900	積数	3,300
超過準備	1,896,900	1日平均	200
非準備先残高	256,200	積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,917,300
準備預金進捗率	99.83% (実績)		51.72% (日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	112.42-44
-0.045	0.020	為替(5時)	112.95-97

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	2/23	2/24	2/25	2/26	2/29	3/1
日銀当預残	2,584,200	2,582,100	2,575,100	2,585,900	2,589,900	2,592,700
準備預金残	2,350,100	2,351,800	2,341,200	2,334,900	2,346,000	2,336,500
レート	-0.001%	-0.003%	-0.003%	-0.002%	-0.001%	-0.003%
月中平均	0.04317%	0.04125%	0.03948%	0.03504%	0.03379%	-0.00300%

3/1の加重平均レート(速報)				2/29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		
▲0.04 ~0.001 (▲0.003)	0.001 (0.001)			▲0.01 ~0.010 (▲0.001)	▲0.005 ~0.001 (▲0.002)	0.001 (0.001)		
0.000 (0.000)								
▲0.005 ~0.001 (▲0.001)								
▲0.001 ~0.001 (0.000)								
0.002 (0.002)		0.001-0.10	-		▲0.005 ~0.280 (0.043)			
		0.001-0.10	-				有担先日付分	
		0.001-0.10	▲0.10					
		-	-					
		-	-					

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完 16,480億円 3/1 ~ 3/2 (1日間) 応札 159億円 落札 159億円 -0.500% 全取 平均 -0.500% (即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 3/3~3/10 (7日間) 応札 1,000万ドル 落札 1,000万ドル 貸付利率 0.880%
 10年利付国債(表面利率0.1%) 応札6兆9,973億円 落札2兆1,879億円(I非競争入札:2,104億円) 3/22~2026/3/20 ▲0.015% 按分9.1976% 平均▲0.024%
 交付税特会 1兆500億円 3/9~9/7 応札 9兆9,051億円 落札 1兆500億200万円 0.001% 按分 11.1643% 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