

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/2(水)

<<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想 金額	4日当社予想 金額
	即日	金額		
銀行券		100	▲ 300	0
財政		▲ 52,300	▲ 2,700	5,000
資金過不足		▲ 52,200	▲ 3,000	5,000
貸出				
売出手形				
本店共通				
全店共通				
共通(固定)				
		58,669		
国債買現				
CP買現				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入		13,400		5,200
CP等買入				
		▲ 400	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 271,714				7,100
被災地支援				
		3,144		
社債等買入				
ETF買入				
国債補充供給		200		
小計		13,200	▲ 100	10,300
当増減		▲ 39,000	▲ 3,100	15,300

当座預金残高	2,553,700	3/2以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,300,300		3,300
積み終了先	1,862,100	3/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,862,000	積数	2,300
非準備先残高	253,400	1日平均	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	99.88% (実績)		55.17% (日数)

3/1のマネタリーベース		3,591,000	
3/1コール 合計	51,478	無担	35,269
コール前日増減	計	▲ 2,007	無担 ▲ 2,099 有担 92

3/2の加重平均レート(速報)				3/1の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
▲0.04 ~ 0.001 (▲0.002)	0.001	(0.001)		▲0.04 ~ 0.001 (▲0.003)		0.001	(0.001)
0.000 ~ 0.050 (0.005)						0.000	(0.000)
▲0.01 ~ 0.010 (▲0.001)				1W ▲0.005 (▲0.005)	▲0.005 ~ 0.001 (▲0.001)		
				2W ▲0.001 ~ 0.000 (0.000)	0.000 ~ 0.001 (0.000)		
				3W			
		0.001-0.10	-	1M 0.002	(0.002)		有担先日付分
		0.001-0.10	-	2M			
		0.001-0.10	▲0.095	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	10,000億円	3/2	~ 3/3 (1日間)	応札	1億円	落札	1億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
国債買入	700億円	3/4	応札	4,041億円	落札	701億円		0.115%	53.9%	平均利回り較差	0.127%
国債買入	4,500億円	3/4	応札	12,401億円	落札	4,508億円		0.010%	96.6%	平均利回り較差	0.011%

「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録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

<< 3/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,550,600	前日比	▲ 3,100
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。

<< 2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4兆9,000億円減の186兆3,000億円(当座預金残高見込みは、255兆7,000億円)。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。財政等要因で大幅な不足日であったものの、レート水準に変化はなく、▲0.01~0.001%のレンジでの出合いとなった。午後に入ってもレート水準は変わらず、▲0.01~0.001%での出合いが数件見られる程度で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。

<< 2日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは低水準で推移した。短国市場は3M物で▲0.095%の出合いが少額見られた程度と終日閑散だった。CP市場は償還総額1,600億円程度に対して、商社、鉄鋼、機械業態から大型発行案件が見られ、発行総額は1,700億円弱となった。引き続き長めのタームでは堅調な買いが見られた。

<< 3日の材料 >>
 *中曾日銀副総裁、沖縄県金融経済懇談会にて講演
 *3月の日銀当座預金増減要因見込み
 *米国1月の製造業新規受注・出荷・在庫
 *米国2月のISM非製造業景況指数
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、3/7発行)
 *流動性供給入札(3,000億円、3/7発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、3/11借入)

<<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%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	113.91-93
-0.040 0.005	16,746.55 661.04	為替(5時)	114.24-26

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	2/24	2/25	2/26	2/29	3/1	3/2
日銀当預残	2,582,100	2,575,100	2,585,900	2,589,900	2,592,700	2,553,700
準備預金残	2,351,800	2,341,200	2,334,900	2,346,000	2,337,000	2,300,300
レート	-0.003%	-0.003%	-0.002%	-0.001%	-0.003%	-0.002%
月中平均	0.04125%	0.03948%	0.03504%	0.03379%	-0.00300%	-0.00250%