CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/3(木)　　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想	7日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 200	1,000
財政		▲ 3,800	2,800	▲ 1,000
資金過不足		▲ 3,900	2,600	0
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 58,669				200 ▲ 500
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			5,500	
CP等買入		▲ 100	▲ 600	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 271,714			7,100 ▲ 3,400	100 ▲ 100
被災地支援 3,144				
社債等買入				
ETF買入			100	
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		▲ 200	8,800	▲ 300
当預増減		▲ 4,100	11,400	▲ 300

当座預金残高	2,549,600	3/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,305,000		2,300
積み終了先	1,867,200	3/4以降の残り所要積立額	
超過準備	1,867,200	積数	1,700
非準預先残高	244,600	1日平均	100
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　99.91%　(実績)　58.62%　(日数)

3/2のマネタリーベース				3,551,900		
3/2コール	合計	56,176	無担	39,754	有担	16,422
コール前日増減	計	4,698	無担	4,485	有担	213

≪ 3/4の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,561,000	前日比	11,400
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。

≪ 3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7,000億円増の187兆円(当座預金残高見込みは、255兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、昨日と同様、▲0.01%のオファーに対し、▲0.02%のビッドで始まった。その後、国内勢より▲0.01～0.001%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後に入ると、0～0.001%での出合いが数件見られた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。共通担保資金供給オペは、3M物で8,000億円オファーされ、応札額190億円（期落ち額450億円）で札割れとなった。

≪ 3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物の入札が実施された。WI取引で▲0.10%が少額の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.1018%、按分落札利回▲0.0902%と堅調ながらも、按分利回は事前予想より若干小甘い結果となった。セカンダリーでは▲0.102～▲0.095%での出合いが見られた。CP市場は償還総額1,600億円強に対して、石油業態から大型発行案件が見られたものの、発行件数は膨らまず発行総額は900億円強となった。発行レートは引き続き極めて低い水準での決着となった。

≪ 4日の材料 ≫

*1月の毎月勤労統計調査速報
*米国1月の貿易収支
*米国2月の雇用統計

≪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)	113.49-51
-0.020	0.020	16,960.16	213.61	為替(5時)	114.13-15

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	2/25	2/26	2/29	3/1	3/2	3/3
日銀当預残	2,575,100	2,585,900	2,589,900	2,592,700	2,553,700	2,549,600
準備預金残	2,341,200	2,334,900	2,346,000	2,337,000	2,300,300	2,305,000
レート	-0.003%	-0.002%	-0.001%	-0.003%	-0.002%	-0.002%
月中平均	0.03948%	0.03504%	0.03379%	-0.00300%	-0.00250%	-0.00233%

3/3 の加重平均レート(速報)					3/2 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 (▲0.002)	0.001 (0.001)			O/N	▲0.04 ～0.001 (▲0.002)		0.001 (0.001)	
0.000 ～0.001 (0.001)				T/N		0.000 ～0.050 (0.005)		
				S/N				
▲0.01 ～0.000 (▲0.005)				1W	▲0.01 ～0.000 (▲0.003)	0.000 ～0.010 (0.001)		
0.000 (0.000)				2W				
				3W				
0.000 (0.000)		0.001-0.10	-	1M			有担先日付分	
		0.001-0.10	-	2M				
		0.001-0.10	▲0.102-▲0.095	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

≪オペ情報、入札結果≫

全店共通	8,000億円	3/7	～	6/6	(91日間)	応札	190億円	落札	190億円	0.000%	全 取	平 均	0.000%	(固定)
国債補完	20,000億円	3/3	～	3/4	(1日間)	応札	135億円	落札	135億円	-0.500%	全 取	平 均	-0.500%	(即)
国債補完	10,000億円	3/3	～	3/4	(1日間)	応札	5億円	落札	5億円	-0.500%	全 取	平 均	-0.500%	(即)

T-Bill3M　応札17兆2,954億円　落札4兆1,171億7,000万円(非競争入札:3,828億円) 3/7～6/6 ▲0.0902% 按分39.5076% 平均▲0.1018%
流動性供給 応札 1兆944億円　落札 2,997億円 3/7 募入最大利回較差 ▲0.010% 按分 61.6858% 募入平均利回較差 ▲0.017%
交付税特会 1兆500億円 3/11～9/9 応札 10兆2,874億円　落札 1兆500億500万円 0.001% 按分10.2068% 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