

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/8(火)

《セントラル短資株式会社》

## 《資金需給》

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,100	400	0
財政		1,400	9,000	▲ 7,000
資金過不足		2,500	9,400	▲ 7,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
58,409				
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		13,700		
CP等買入				5,000
		▲ 100	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 63,567 (増加) 271,714				
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		
		200	100	
小計		21,300	▲ 200	5,000
当増減		23,800	9,200	▲ 2,000

《 3/9の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,590,500	前日比	9,200
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。

### 《 8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2兆6,000億円増の190兆5,000億円(当座預金残高見込みは、258兆3,000億円)。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%での調達が見られた。また、複数の業態が0.001%で試し取りを行った。午後に入ると、0~0.001%の調達が数件見られ、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。

### 《 8日のオープン市場動向 》

短国現先レートS/Nは前日から横ばい圏で推移した。短国6M物の入札は、W I取引で▲0.125%の小額出合いが見られる中、按分落札レート▲0.1196%(按分比率14.4707%)、平均落札レート▲0.1294%と、概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは▲0.14%の小額出合いが見られた他、3M物が▲0.09%で小額出合った。CP市場は償還総額2,200億円程度に対して、発行総額1,900億円程度で、鉄鋼、電機、不動産等の業態からまとまった発行案件が見られた。発行レートは、引き続き期越え物を中心に0.00%付近となっている。

### 《 9日の材料 》

- \*2月のマネーストック
- \*米国1月の卸売上高

当座預金残高	2,581,300	3/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,337,900		300
積み終了先	1,903,900	3/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,903,900	積数	200
非準備預金残高	243,400	1日平均	0
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,922,800		
準備預金進捗率	99.99% (実績)	75.86% (日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	113.48-50
-0.100 ▲ 0.050	16,783.15 ▲ 128.17	為替(5時)	112.94-95

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	3/1	3/2	3/3	3/4	3/7	3/8
日銀当預残	2,592,700	2,553,700	2,549,600	2,561,700	2,557,500	2,581,300
準備預金残	2,337,000	2,300,300	2,305,100	2,313,800	2,317,300	2,337,900
レート	-0.003%	-0.002%	-0.002%	-0.001%	-0.001%	0.000%
月中平均	-0.00300%	-0.00250%	-0.00233%	-0.00167%	-0.00157%	-0.00138%

3/7のマネターベース				3,554,700	
3/7コール	合計	58,806	無担	42,770	有担
コール前日増減	計	▲ 711	無担	▲ 1,062	有担
					351

3/8の加重平均レート(速報)				3/7の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分	
▲0.01 ~ 0.001 (0.000)	0.001	(0.001)		▲0.01 ~ 0.001 (▲0.001)				0.001	(0.001)
0.000 ~ 0.001 (0.001)						0.000 ~ 0.001 (0.001)			
▲0.01 ~ 0.000 (▲0.004)						0.000 (0.000)			
0.000 (0.000)						0.000 (0.000)			
0.100 (0.100)			0.001-0.10	▲0.15	1M				有担先日付分
			0.001-0.10	-	2M				
			0.001-0.10	▲0.09	3M				
			-	▲0.14-▲0.125	6M				
			-	-	1Y				

## 《オペ情報、入札結果》

国債補完 1,706億円 3/8 ~ 3/9 (1日間) 応札 100億円 落札 100億円 -0.500% 全取 平均 -0.500%(即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 3/10~3/17 (7日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.870%

T-Bill6M 応札13兆791億円 落札3兆2,204億7,000万円(非競争入札:2,795億円) 3/10~9/12 ▲0.1196% 按分14.4707% 平均▲0.1294%

30年利付国債(表面利率0.8%) 応札3兆548億円 落札7,261億円(I非競争入札:732億円) 3/22~2046/3/20 0.767% 按分76.2871% 平均0.765%

ETF買入 336億円 約定日 3/8

「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