

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/9(水)

◀セントラル短資株式会社▶

## ◀資金需給▶

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		400	▲ 200	0
財政		7,700	▲ 9,900	3,000
資金過不足		8,100	▲ 10,100	3,000
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				
国庫短期証売却				
国債買入				8,900
CP等買入		▲ 300	▲ 600	
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			▲ 100	
ETF買入				
国債補充供給		100		
小計		▲ 200	4,300	8,900
当増減		7,900	▲ 5,800	11,900

◀ 3/10の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,583,400	前日比	▲ 5,800
O/N	▲0.02~0.001	T/N	▲0.02~0.001	S/N	▲0.02~0.001

無担O/Nは、0%前後での出会いが中心になると見込まれる。

### ◀ 9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191兆7,000億円(当座預金残高見込みは、259兆1,000億円)。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%での調達が見られた。また、一部業態が昨日に続き0.001%で試し取りを行った。午後は閑散とした状況の中、0~0.001%の調整程度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%前後での出会いが散見された。

### ◀ 9日のオープン市場動向 ▶

短国現先レートS/Nはレートが小幅低下との印象だった。短国アウトライト市場は3M物で▲0.095~▲0.085%、6M物で▲0.20~▲0.14%の出会いが見られた。CP市場は償還総額3,100億円程度に対し、発行総額600億円程度だった。石油、小売業態からのまとまった発行案件が見られたが、3月末に向けた有利子負債削減の動きもあり、発行案件は少なめで、発行レートは引き続き0.00%付近の低水準だった。

### ◀ 10日の材料 ▶

- \*1月の特定サービス産業動態統計速報
- \*2月の企業物価指数
- \*ECB定例理事会(金融政策発表)
- \*米国2月の財政収支
- \*国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、3/14発行)
- \*5年利付国債入札(25,000億円、3/22発行)

当座預金残高	2,589,200	3/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,348,500		200
積み終了先	1,916,400	3/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,916,400	積数	200
非準備先残高	240,700	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)	79.31% (日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	112.68-70
-0.020	0.080	16,642.20	▲ 140.95
		為替(5時)	112.47-48

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	3/2	3/3	3/4	3/7	3/8	3/9
日銀当座預金	2,553,700	2,549,600	2,561,700	2,557,500	2,581,300	2,589,200
準備預金残高	2,300,300	2,305,100	2,313,800	2,317,300	2,338,300	2,348,500
レート	-0.002%	-0.002%	-0.001%	-0.001%	0.000%	-0.001%
月中平均	-0.00250%	-0.00233%	-0.00167%	-0.00157%	-0.00138%	-0.00133%

3/8のマナターベース		3,577,500	
3/8コール	合計	61,960無担	46,582有担
コール前日増減	計	3,154無担	3,812有担
			▲ 658

3/9の加重平均レート(速報)				3/8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		有担当日分	
▲0.01~0.001 (▲0.001)		0.001 (0.001)						▲0.01~0.001 (0.000)		0.001 (0.001)	
0.000~0.001 (0.001)								0.000~0.001 (0.001)			
▲0.01~0.001 (▲0.002)								0.000 (0.000)		▲0.01~0.000 (▲0.005)	
0.280 (0.280)								0.000 (0.000)			
								0.117 (0.117)			
0.140 (0.140)				0.001-0.10		-		0.100 (0.100)		有担先日付分	
				0.001-0.10		▲0.13					
				0.001-0.10		▲0.095-▲0.085					
						▲0.20-▲0.14					

## ◀オペ情報、入札結果▶

国債買入	4,500億円	3/11	応札	10,024億円	落札	4,500億円	按分利回り較差	0.015%	40.0%	平均利回り較差	0.032%
国債買入	2,600億円	3/11	応札	9,338億円	落札	2,605億円	按分利回り較差	0.090%	94.6%	平均利回り較差	0.090%
国債買入	1,800億円	3/11	応札	5,064億円	落札	1,801億円	按分利回り較差	0.051%	68.0%	平均利回り較差	0.079%
ETF買入	336億円	約定日	3/9								

「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の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