

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/14(月)

◀セントラル短資株式会社▶

## ◀資金需給▶

単位 億円

	14日需給速報		15日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		900	400	0
財政		4,700	▲ 10,800	2,000
資金過不足		5,600	▲ 10,400	2,000
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			12,500	
国庫短期証売却				
国債買入			13,100	
CP等買入				
		▲ 400	▲ 1,000	
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	即日	▲ 400		
		200	400	
小計		▲ 600	24,900	0
当預増減		5,000	14,500	2,000

◀ 3/15の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,611,200	前日比	14,500
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。

### ◀ 14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4,000億円増の192兆5,000億円(当座預金残高見込みは、259兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、先週末と同様、▲0.01%のオフアーに対し、▲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%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%前後での出合いが散見された。

### ◀ 14日のオープン市場動向 ▶

現先レートS/Nは低位横ばい圏で推移。短国市場は日銀政策決定会合期間ということもあり様子見姿勢が強く、3M物で▲0.09%の出合いが小額みられた程度であった。CP市場は発行案件が少なく、閑散であった。

### ◀ 15日の材料 ▶

- \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- \*黒田日銀総裁、定例会見
- \*1月の第3次産業活動指数
- \*1月の石油等消費動態統計
- \*米国FOMC(1日目)
- \*米国2月の生産者物価指数
- \*米国2月の小売売上高
- \*米国1月の企業在庫

当座預金残高	2,596,700	3/14以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	2,356,600	3/15以降の残り所要積立額	0
積み終了先	1,925,000	積数	0
超過準備	1,925,000	1日平均	0
非準備先残高	240,100		
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	100.00% (実績)	96.55%	(日数)

JGB新発10年債	
-0.049	▲ 0.034

日経平均株価(終値)	
17,233.75	294.88

為替(9時)	113.77-79
為替(5時)	113.76-77

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	3/7	3/8	3/9	3/10	3/11	3/14
日銀当預残	2,557,500	2,581,300	2,589,200	2,582,200	2,591,700	2,596,700
準備預金残	2,317,300	2,338,300	2,350,000	2,336,700	2,352,700	2,356,600
レート	-0.001%	0.000%	-0.001%	-0.003%	-0.001%	-0.002%
月中平均	-0.00157%	-0.00138%	-0.00133%	-0.00150%	-0.00138%	-0.00143%

3/11のマナタリーベース			3,587,900
3/11コール 合計	64,264	無担	49,573
コール前日増減	計 1,427	無担	2,348
		有担	▲ 921

3/14の加重平均レート(速報)				3/11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	有担先日付分	
▲0.04 ~ 0.001 (▲0.002)	0.001 (0.001)			▲0.01 ~ 0.001 (▲0.001)	0.000 ~ 0.001 (0.001)	0.001 (0.001)		
▲0.01 ~ 0.001 (▲0.003)					0.050 ~ 0.300 (0.092)			
					▲0.005 (▲0.005)			
0.280 (0.280)					0.050 (0.050)			
		0.001-0.10	-					有担先日付分
		0.001-0.10	-					
		0.001-0.10	▲0.09					
		-	-					
		-	-					
		-	-					

## ◀オベ情報、入札結果▶

国債補完 17,390億円 3/14 ~ 3/15 (1日間) 応札 392億円 落札 392億円 -0.500% 全取 平均 -0.500% (即)

「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