

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/16(水)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	16日需給速報		17日需給予想		18日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 1,200	▲ 1,000		
財政		2,000	3,200	13,000		
資金過不足		1,400	2,000	12,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)				6,600		
58,409				▲ 13,200		
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				12,700		
CP等買入						
		▲ 500	▲ 100			
貸出支援基金(成長)				23,500		
63,567(増加) 271,714				▲ 5,500		
被災地支援						
3,144						
社債等買入						
ETF買入						
国債補完供給	即日	▲ 2,200				
		1,200	2,200			
小計		▲ 1,500	2,100	24,100		
当預増減		▲ 100	4,100	36,100		

3/17の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,612,900	前日比	4,100
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。

《 16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、前日比2,000億円減少の193兆6,000億円(当座預金残高見込みは261兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、▲0.01%のオファーに対して、▲0.02%のビッドで始まった。新しい積みの初日で調達側に様子見姿勢が見られる中で、一巡後は国内勢より▲0.01~0.001%の調達で推移した。午後に入ると、0%程度での調整の調達が見られ、本日の取引を終了した。ターム物は、ショートターム物で0%前後での出合いが散見された。3M物の共通担保オペが1兆5,000億円オファーされ、結果は落札総額6,550億円。期落ち額1兆3,150億円に対して応札金額は減少し札割れとなった。

《 16日のオープン市場動向 》
 現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は1Y物の入札が実施された。W I取引で▲0.160%の出合いがみられた中、按分落札利回りは▲0.1531% (按分比率13.2946%)、平均落札利回りは▲0.1641%と前回(按分▲0.1501%、平均▲0.1601%)より低下し、過去最低利回りを更新した。セカンダリーでは▲0.200%と買い進まれた。また、3M物で▲0.115~▲0.110%、6M物で▲0.155%の出合いがみられた。CP市場は20日にかかる発行となり鉄鋼、電機、石油業態からまとまった発行が見られ、発行総額は2,500億円程度に膨らんだ。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

《 17日の材料 》
 *黒田日銀総裁、決済システムフォーラムにて講演
 *2月の貿易統計 *英中銀MPC結果発表
 *ユーロ圏2月の消費者物価指数改定値
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、3/22発行)
 *20年利付国債入札(12,000億円、3/22発行)

《コール2月積み期間分の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	-0.00245%	有担 0.00100%
(営業日のみ)	無担	-0.00224%	有担 0.00100%

当座預金残高	2,608,800	3/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,364,200		2,047,100
積み終了先	848,900	3/17以降の残り所要積立額	
超過準備	574,500	積数	687,400
非準備先残高	244,600	1日平均	22,900
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)			2,047,100
準備預金進捗率	66.42% (実績)	3.23%	(日数)

JGB新発10年債	-0.054	▲ 0.029	日経平均株価(終値)	16,974.45	▲ 142.62	為替(9時)	113.09-12
						為替(5時)	113.64-65

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	3/9	3/10	3/11	3/14	3/15	3/16
日銀当預残	2,589,200	2,582,200	2,591,700	2,596,700	2,608,900	2,608,800
準備預金残	2,350,000	2,336,700	2,352,700	2,357,900	2,365,400	2,364,200
レート	-0.001%	-0.003%	-0.001%	-0.002%	-0.002%	0.002%
月中平均	-0.00133%	-0.00150%	-0.00138%	-0.00143%	-0.00147%	-0.00125%

3/16の加重平均レート(速報)				3/15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	
▲0.04 ~0.125 (0.002)	0.001	(0.001)	CP気配a-1	短国	O/N	▲0.04 ~0.010 (▲0.002)		0.001	(0.001)
0.000 ~0.001 (0.001)					T/N	▲0.01 ~0.001 (▲0.001)			
					S/N				
▲0.01 ~0.040 (▲0.005)					1W	▲0.01 (▲0.010)			
▲0.01 ~0.000 (▲0.005)					2W	▲0.01 ~0.001 (▲0.005)			
					3W				
0.130 (0.130)			0.001-0.10	-	1M	0.140 (0.140)			有担先日付分
			0.001-0.10	-	2M				
			0.001-0.10	▲0.115-▲0.11	3M				
			-	▲0.155	6M				
			-	▲0.20-▲0.16	1Y				

《オペ情報、入札結果》

全店共通	15,000億円	3/18	~ 6/28 (102日間)	応札	6,550億円	落札	6,550億円	0.000%	全取	平均	0.000% (固定)
国債補完	20,000億円	3/16	~ 3/17 (1日間)	応札	2,058億円	落札	2,058億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
国債補完	16,476億円	3/16	~ 3/17 (1日間)	応札	28億円	落札	28億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
国債買入	4,000億円	3/18	応札	8,803億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	-0.004%	74.9%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	4,200億円	3/18	応札	12,528億円	落札	4,204億円	按分利回り較差	-0.004%	97.0%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	4,500億円	3/18	応札	11,435億円	落札	4,503億円	按分利回り較差	-0.008%	35.1%	平均利回り較差	-0.001%
T-Bill1Y	応札10兆4,961億円	落札2兆2,846億8,000万円(非競争入札:2,153億円)	3/22~2017/3/21	▲0.1531%	按分13.2946%	平均▲0.1641%					
貸出増加支援	3/18~2017/3/17 (364日間)	貸付予定総額	23億円	貸付利率	0%						
貸出増加支援	3/18~2018/3/16 (728日間)	貸付予定総額	0億円	貸付利率	0%						
貸出増加支援	3/18~2020/3/18 (1461日間)	貸付予定総額	23,462億円	貸付利率	0%						

「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り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