CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/18(金)　　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	18日需給速報		22日需給予想	23日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,000	▲ 300	▲ 1,000
財政		7,500	43,100	4,000
資金過不足		5,500	42,800	3,000
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 51,809		6,600 ▲ 13,200	4,800 ▲ 11,200	
国債買現 0			3,900	▲ 3,800
CP買現 0				
国庫短期証買入				17,500
国庫短期証売却				
国債買入		13,000		12,600
CP等買入		▲ 800	▲ 800	5,000
貸出支援基金 (成長) 63,567 (増加) 289,658		23,500 ▲ 24,400		
被災地支援 3,144				
社債等買入		▲ 900	▲ 300	
ETF買入			200	
国債補完供給	即日	▲ 2,300 2,200	2,300	
小計		3,700	▲ 1,100	31,300
当預増減		9,200	41,700	34,300

当座預金残高	2,618,900
準備預金残高	2,371,000
積み終了先	1,931,300
超過準備	1,891,600
非準預先残高	247,900

3/18以降の残り所要積立額	
	276,200
3/22以降の残り所要積立額	
積数	71,800
1日平均	2,900

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　96.49%　(実績)　19.35%　(日数)

3/17のマネタリーベース		3,606,400				
3/17コール	合計	47,666	無担	34,123	有担	13,543
コール前日増減	計	292	無担	590	有担	▲ 298

≪ 3/22の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,660,600	前日比	41,700
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が、若干低下する可能性も考えられる。

≪ 18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3,000億円増加の194兆4,000億円(当座預金残高見込みは262兆1,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは、▲0.01%のオファーに対して、▲0.02%のビッドで始まった。その後、国内勢より▲0.01～0%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散見され、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。

≪ 18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した。短国市場は短国買入オペが1兆7,500億円でオファーされ、平均利回り較差+0.007%、按分利回り較差▲0.004%（按分比率89.7%）と落ち着いた結果となった。オペ後は3M物が▲0.11%、6M物が▲0.16%、1Y物が▲0.225～▲0.22%と、散発的な出合いが見られた。CP市場は発行案件、発行総額ともに少なく、閑散としていた。

≪ 22日の材料 ≫

*英国2月の消費者物価指数

≪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%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	111.38-39
-0.100	▲ 0.046	16,724.81	▲ 211.57	為替(5時)	111.33-34

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	3/11	3/14	3/15	3/16	3/17	3/18
日銀当預残	2,591,700	2,596,700	2,608,900	2,608,800	2,609,700	2,618,900
準備預金残	2,352,700	2,357,900	2,365,400	2,367,500	2,364,900	2,371,000
レート	-0.001%	-0.002%	-0.002%	0.002%	-0.003%	-0.002%
月中平均	-0.00138%	-0.00143%	-0.00147%	-0.00125%	-0.00135%	-0.00148%

単位 (%)

3/18 の加重平均レート(速報)					3/17 の加重平均レート(確報)		
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
▲0.01 ～0.001 (▲0.002)	0.001 (0.001)			O/N	▲0.04 ～0.001 (▲0.003)		0.001 (0.001)
0.000 (0.000)				T/N		0.000 (0.000)	
				S/N			
0.050 ～0.300 (0.092)				1W	▲0.01 ～▲0.005 (▲0.006)	0.001 (0.001)	
0.130 (0.130)				2W	▲0.015 ～▲0.001 (▲0.013)		
0.000 (0.000)				3W			
0.130 (0.130)		0.001-0.10	-	1M		▲0.01 (▲0.010)	有担先日付分
		0.001-0.10	-	2M			
		0.001-0.10	▲0.11	3M			
		-	▲0.16	6M			
		-	▲0.225-▲0.22	1Y			

≪オペ情報、入札結果≫

国債買現	5,000億円	3/22	～	3/23	(1日間)	応札	6,518億円	落札	3,848億円	-0.200%	全 取	平 均	-0.120%
国債補完	20,000億円	3/18	～	3/22	(4日間)	応札	2,214億円	落札	2,214億円	-0.500%	全 取	平 均	-0.500% (即)
国短買入	17,500億円	3/23				応札	38,397億円	落札	17,503億円	按分利回り較差	-0.004%	89.7%	平均利回り較差 0.007%
国債買入	4,000億円	3/23				応札	7,632億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	-0.048%	53.2%	平均利回り較差 -0.033%
国債買入	4,200億円	3/23				応札	11,250億円	落札	4,202億円	按分利回り較差	-0.044%	34.5%	平均利回り較差 -0.033%
国債買入	2,600億円	3/23				応札	3,503億円	落札	2,600億円	按分利回り較差	-0.147%	5.8%	平均利回り較差 -0.060%
国債買入	1,800億円	3/23				応札	3,558億円	落札	1,800億円	按分利回り較差	-0.240%	85.0%	平均利回り較差 -0.135%

被災地支援(第59回) 3/25～2017/3/24 (364日間) 貸付予定総額 0億円　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しする書面や目論見書をよくお読みください。