CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/22(火)　　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	22日需給速報		23日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 300	▲ 2,000
財政		39,700	2,400	3,000
資金過不足		39,600	2,100	1,000
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 45,449		4,800 ▲ 11,200		
国債買現 3,848		3,900	▲ 3,900	
CP買現 0				
国庫短期証買入			17,500	
国庫短期証売却				
国債買入			13,800	5,200
CP等買入		▲ 800	5,000 ▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 63,567 (増加) 289,658				
被災地支援 3,144				
社債等買入		▲ 300		
ETF買入		200		
国債補完供給	即日	▲ 1,900 2,300	1,900	
小計		▲ 3,000	34,100	5,200
当預増減		36,600	36,200	6,200

≪ 3/23の日銀調節とレート予想 ≫					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,691,700	前日比	36,200
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。					

≪ 22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1兆9,000億円増加の196兆3,000億円(当座預金残高見込みは266兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、先週末同様▲0.01%のオファーに対して、▲0.02%のビッドで立ち上がった。国債の大量償還日であったものの、特段の影響も無く、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。

≪ 22日のオープン市場動向 ≫

現先S/N物は引続き低位で推移した。短国市場は特段の材料も無く、閑散な地合が続いた。CP市場は、ノンバンク、電機機器、機械業態でまとまった発行が見られ、償還総額1,200億円程度に対し、発行総額は1,500億円程度となった。発行レートは、a-1格以上の期越物の大部分が0%で決着するなど、引続き極めて低い水準で推移した。

≪ 23日の材料 ≫

*月例経済報告
*布野日銀審議委員、兵庫県金融経済懇談会にて講演
*米国2月の新築一戸建て販売件数
*流動性供給入札(5,000億円、3/25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	2,655,500	3/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,411,800		71,800
積み終了先	1,943,000	3/23以降の残り所要積立額	
超過準備	1,943,000	積数	58,500
非準預先残高	243,700	1日平均	2,400
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　97.14%　(実績)　22.58%　(日数)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	112.14-16
-0.100	0.000	17,048.55	323.74	為替(5時)	111.73-75

3/18のマネタリーベース				3,617,700		
3/18コール	合計	41,225	無担	28,383	有担	12,842
コール前日増減	計	▲ 6,441	無担	▲ 5,740	有担	▲ 701

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	3/14	3/15	3/16	3/17	3/18	3/22
日銀当預残	2,596,700	2,608,900	2,608,800	2,609,700	2,618,900	2,655,500
準備預金残	2,357,900	2,365,400	2,367,500	2,364,900	2,371,000	2,411,800
レート	-0.002%	-0.002%	0.002%	-0.003%	-0.002%	-0.003%
月中平均	-0.00143%	-0.00147%	-0.00125%	-0.00135%	-0.00148%	-0.00155%

3/22 の加重平均レート(速報)

無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国	
▲0.04 ～0.010 (▲0.003)	0.001 (0.001)			O/N
0.000 (0.000)				T/N
				S/N
▲0.001 ～0.080 (0.023)				1W
0.100 (0.100)				2W
				3W
0.100 ～0.130 (0.117)		0.001-0.10	-	1M
		0.001-0.10	▲0.115	2M
		0.001-0.10	▲0.115	3M
		-	-	6M
		-	▲0.23-▲0.225	1Y

3/18 の加重平均レート(確報)　単位 (%)

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)
	0.000 (0.000)	
	0.050 ～0.300 (0.092)	
	0.130 (0.130)	
	0.000 (0.000)	
	0.130 (0.130)	有担先日付分

≪オペ情報、入札結果≫

国債補完	46,670億円	3/22	～	3/23	(1日間)	応札	1,757億円	落札	1,757億円	-0.500%	全 取	平 均	-0.500% (即)
国債補完	5,330億円	3/22	～	3/23	(1日間)	応札	39億円	落札	39億円	-0.500%	全 取	平 均	-0.500% (即)
国債買入	700億円	3/24	応札	2,899億円	落札		701億円	按分利回り較差		0.015%	82.7%	平均利回り較差	0.017%
国債買入	4,500億円	3/24	応札	13,962億円	落札		4,503億円	按分利回り較差		-0.015%	13.9%	平均利回り較差	-0.004%
社債買入	1,500億円	3/28	応札	2,625億円	落札		1,500億円	按分レート		-0.251%	94.1%	平均落札レート	-0.143%

米ドル資金供給(固定金利方式)　3/24～3/31 (7日間)　応札なし　貸付利率 0.880%

「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