

# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/24(木)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想		28日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,500	▲ 1,300		0	
財政		▲ 3,000	17,900	11,000		
資金過不足		▲ 4,500	16,600	11,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			600	700		
45,449			▲ 8,200			
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		5,300		12,200		
CP等買入						
		▲ 300	▲ 1,200			
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			▲ 100	1,500		
ETF買入			500			
国債補完供給	即日	▲ 2,700				
		2,400	2,700			
小計		4,700	▲ 5,700	14,400		
当預増減		200	10,900	25,400		

3/25の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,701,600	前日比	10,900
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。

《 24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5,000億円増加の198兆7,000億円(当座預金残高見込みは269兆6,000億円)。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。立ち上がりは▲0.01~0.001%での出合い。一巡後は0%程度の出合いを中心に推移して、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。2W物の共通担保オベが8,000億円オファーされ、落札総額680億円の結果となった。

《 24日のオープン市場動向 》

現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は3M物の入札が実施された。W I 取引で▲0.105%の出合いが見られ、平均落札利回▲0.1038%、最高落札利回▲0.1002%と概ね事前予想通りの結果になった。セカンダリーは▲0.105%の出合いが見られた他、▲0.120%で少額の出合いも見られた。CP市場は建設、ノンバンク業態を中心にまとまった発行が見られ、発行総額は2,200億円程度に達した。発行レートは引続き低位横ばいで推移した。

《 25日の材料 》

- \*10-12月期の資金循環統計速報
- \*1月の景気動向指数改訂状況
- \*2月全国・3月都区部消費者物価指数(CPI)
- 市場予想：全 国(2月)前年同月比(除く生鮮)：+0.1%
- 東京都区部(3月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.2%
- \*2月の企業向けサービス価格指数
- \*米国10-12月期のGDP確報値
- \*欧州・英国祝日(Good Friday)
- \*2年利付国債入札(23,000億円、4/15発行)

当座預金残高	2,690,700	3/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,436,500		47,100
積み終了先	1,972,700	3/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,972,300	積数	37,800
非準備先残高	254,200	1日平均	1,700
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	98.15% (実績)		29.03% (日数)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)		112.41-44
-0.094	0.016	16,892.33	▲ 108.65	為替(5時)		112.85-87

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	3/16	3/17	3/18	3/22	3/23	3/24
日銀当預残	2,608,800	2,609,700	2,618,900	2,655,500	2,690,500	2,690,700
準備預金残	2,367,500	2,364,900	2,371,000	2,412,400	2,436,300	2,436,500
レート	0.002%	-0.003%	-0.002%	-0.003%	-0.004%	-0.003%
月中平均	-0.00125%	-0.00135%	-0.00148%	-0.00155%	-0.00165%	-0.00171%

3/23のマネタリーベース			3,689,700			
3/23コール	合計	39,954	無担	28,245	有担	11,709
コール前日増減	計	▲ 5,496	無担	▲ 4,960	有担	▲ 536

3/24の加重平均レート(速報)				3/23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 ~ 0.005 (▲0.003)	0.001	(0.001)		O/N	▲0.015 ~ 0.005 (▲0.004)		0.001	(0.001)	
▲0.01 ~ 0.000 (▲0.007)				T/N		▲0.001 (▲0.001)			
				S/N					
0.000 ~ 0.117 (0.039)				1W		0.117 (0.117)			
				2W	▲0.01 (▲0.010)	0.000 (0.000)			
				3W					
0.115 (0.115)				1M		0.001 (0.001)			有担先日付分
				2M					
				3M					
				6M					
				1Y					

《オベ情報、入札結果》

全店共通	8,000億円	3/28 ~ 4/11 (14日間)	応札	680億円	落札	680億円	0.000%	全取	平均	0.000%	(固定)
国債補完	52,111億円	3/24 ~ 3/25 (1日間)	応札	2,261億円	落札	2,261億円	-0.500%	全取	平均	-0.500%	(即)
国債補完	25,477億円	3/24 ~ 3/25 (1日間)	応札	318億円	落札	318億円	-0.500%	全取	平均	-0.500%	(即)
国債買入	4,000億円	3/28	応札 12,900億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.004%	31.6%	平均利回り較差	0.001%	
国債買入	4,200億円	3/28	応札 11,713億円	落札	4,200億円	按分利回り較差	-0.006%	30.0%	平均利回り較差	-0.001%	
国債買入	2,400億円	3/28	応札 8,457億円	落札	2,402億円	按分利回り較差	0.025%	55.8%	平均利回り較差	0.038%	
国債買入	1,600億円	3/28	応札 4,603億円	落札	1,601億円	按分利回り較差	0.010%	100.0%	平均利回り較差	0.034%	
T-Bill3M	応札18兆7,861億円	落札4兆625億5,000万円(非競争入札:3,874億円)									

「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