

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/25(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	25日需給速報		28日需給予想	29日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300	100	1,000
財政		18,000	6,500	▲ 2,000
資金過不足		16,700	6,600	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		600	700	600
37,859		▲ 8,200		▲ 2,400
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				10,000
国庫短期証売却				
国債買入			12,800	
CP等買入				
		▲ 1,200	▲ 500	
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	▲ 1,300		
		2,700	1,300	
小計		▲ 7,000	15,800	8,200
当預増減		9,700	22,400	7,200

3/28の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,722,800	前日比	22,400
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。

《 25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4,000億円増加の199兆1,000億円(当座預金残高見込みは270兆2,000億円)。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。その後、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散見され、本日の取引を終了した。ターム物は閑散であった。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550億円(期落ち額2,350億円)となり、札割れとなった。

《 25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、短国買入オペが10,000億円で実施された。結果は平均利回較差+0.003%、按分利回較差+0.001%と実勢水準で決着した。オペ後は3M物で▲0.12%、6M物で▲0.17%、1Y物で▲0.23%の出合いと堅調な展開になっていた。CP市場は食品、機械業態を中心にまとまった発行が見られ、発行総額は1,100億円程度に達した。発行レートは引続き低位横ばいで推移した。

《 26日の材料 》
 *北海道新幹線開業(新青森・新函館北斗間)

《 27日の材料 》
 *中央欧州サマータイム開始

《 28日の材料 》
 *米国2月の個人所得・消費支出
 *欧州・英国祝日(Easter Monday)

当座預金残高	2,700,400	3/25以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,435,400		37,800
積み終了先	1,974,100	3/28以降の残り所要積立額	
超過準備	1,972,600	積数	11,700
非準備先残高	265,000	1日平均	600
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)			2,047,500
準備預金進捗率	99.43% (実績)		38.71% (日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	112.83-86
-0.100 ▲ 0.006	17,002.75 110.42	為替(5時)	113.06-08

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	3/17	3/18	3/22	3/23	3/24	3/25
日銀当預残	2,609,700	2,618,900	2,655,500	2,690,500	2,690,700	2,700,400
準備預金残	2,364,900	2,371,000	2,412,400	2,436,300	2,436,800	2,435,400
レート	-0.003%	-0.002%	-0.003%	-0.004%	-0.003%	-0.007%
月中平均	-0.00135%	-0.00148%	-0.00155%	-0.00165%	-0.00171%	-0.00230%

3/24のマナタリーベース			
		3,691,400	
3/24コール	合計	42,045 無担	30,413 有担
コール前日増減	計	2,091 無担	2,168 有担
			▲ 77

3/25の加重平均レート(速報)				3/24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 ~0.001 (▲0.007)	0.001	(0.001)	CP気配a-1	O/N	▲0.04 ~0.005 (▲0.003)		0.001	(0.001)	
▲0.001 (▲0.001)				T/N		▲0.01 ~0.000 (▲0.007)			
				S/N					
0.000 (0.000)				1W	0.117 (0.117)	0.000 (0.000)			
				2W		0.000 (0.000)			
				3W					
			0.001-0.10	1M		0.115 (0.115)			有担先日付分
			0.001-0.10	2M					
			0.001-0.10	3M					
			-	6M					
			-	1Y					
			▲0.12						
			▲0.17						
			▲0.23						

《オペ情報、入札結果》

全店共通	15,000億円	3/29 ~ 7/8 (101日間)	応札	550億円	落札	550億円	0.000%	全取	平均	0.000% (固定)	
国債補完	29,889億円	3/25 ~ 3/28 (3日間)	応札	1,189億円	落札	1,189億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)	
国短買入	10,000億円	3/29	応札	25,192億円	落札	10,003億円	按分利回り較差	0.001%	94.5%	平均利回り較差	0.003%

2年利付国債(表面利率0.1%) 応札10兆5,742億円 落札 2兆1,090億円(1 非競争入札:1,904億円) 4/15~2018/4/15 ▲0.211% 按分74.6947% 平均▲0.221%

「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