# CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/28(月)　　≪セントラル短資株式会社≫

## ≪資金需給≫

単位 億円

| | 28日需給速報 | | 29日需給予想 | 30日当社予想 |
|---|---|---|---|---|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | 0 | ▲ 400 | 0 |
| 財政 | | 7,000 | ▲ 2,700 | 16,000 |
| 資金過不足 | | 7,000 | ▲ 3,100 | 16,000 |
| 貸出 | | | | |
| 売出手形 0 | | | | |
| 本店共通 0 | | | | |
| 全店共通 0 | | | | |
| 共通(固定) 38,539 | | 700 | 600<br>▲ 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 | | 4,900 |
| CP等買入 | | ▲ 500 | ▲ 800 | |
| 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 | | 1,500 | | |
| ETF買入 | | | | |
| 国債補完供給 | 即日 | ▲ 1,100<br>1,300 | 1,100 | |
| 小計 | | 14,700 | 8,500 | 4,900 |
| 当預増減 | | 21,700 | 5,400 | 20,900 |

| 3/29の日銀調節とレート予想 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 2,727,500 | 前日比 | 5,400 |
| 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。

### ≪ 28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1兆8,000億円増加の200兆9,000億円(当座預金残高見込みは272兆3,000億円)。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%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。

### ≪ 28日のオープン市場動向 ≫

現先S/N物は横ばい圏で推移した。短国市場は特段の材料も無く閑散、3M物で▲0.12%の少額出合いが見られた程度であった。CP市場は償還総額2,200億円程度に対し、一部大型の発行案件が見られたものの、発行総額は1,400億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での取引。CP等買入オペがオファー額6,000億円で実施されたが、落札レートを▲0.598%で足切とする異例の措置を取り落札額は5,304億円にとどまった。これ以下の応札レートは不採用となった。

### ≪ 29日の材料 ≫

*2月の完全失業率(市場予想：3.2%)
*2月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比▲1.5%)
*2月の有効求人倍率(市場予想：1.29倍)
*2月の商業動態統計速報
*米国1月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*米国3月のCB消費者信頼感指数

| | | | |
|---|---|---|---|
| 当座預金残高 | 2,722,100 | 3/28以降の残り所要積立額 | |
| 準備預金残高 | 2,460,100 | | 11,700 |
| 積み終了先 | 2,004,600 | 3/29以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 2,002,500 | 積数 | 6,700 |
| 非準預先残高 | 262,000 | 1日平均 | 400 |
| 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　99.67%　(実績)　41.94%　(日数)

| JGB新発10年債 | | 日経平均株価(終値) | | 為替(9時) | 113.46-48 |
|---|---|---|---|---|---|
| -0.095 | 0.005 | 17,134.37 | 131.62 | 為替(5時) | 113.53-55 |

| 3/25のマネタリーベース | | | | 3,702,400 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 3/25コール | 合計 | 39,492 | 無担 | 28,082 | 有担 | 11,410 |
| コール前日増減 | 計 | ▲ 2,553 | 無担 | ▲ 2,331 | 有担 | ▲ 222 |

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 | 3/18 | 3/22 | 3/23 | 3/24 | 3/25 | 3/28 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 日銀当預残 | 2,618,900 | 2,655,500 | 2,690,500 | 2,690,700 | 2,700,400 | 2,722,100 |
| 準備預金残 | 2,371,000 | 2,412,400 | 2,436,300 | 2,436,800 | 2,436,700 | 2,460,100 |
| レート | -0.002% | -0.003% | -0.004% | -0.003% | -0.007% | -0.007% |
| 月中平均 | -0.00148% | -0.00155% | -0.00165% | -0.00171% | -0.00230% | -0.00246% |

単位 (%)

| 3/28 の加重平均レート(速報) | | | | | 3/25 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 |
| ▲0.04 ～0.005 (▲0.007) | 0.001 (0.001) | | | O/N | ▲0.04 ～0.001 (▲0.007) | | 0.001 (0.001) |
| ▲0.001 (▲0.001) | | | | T/N | | ▲0.001 (▲0.001) | |
| | | | | S/N | | | |
| 0.000 ～0.001 (0.000) | | | | 1W | | 0.000 (0.000) | |
| | | | | 2W | | | |
| | | | | 3W | | | |
| | | 0.001-0.10 | - | 1M | | | 有担先日付分 |
| | | 0.001-0.10 | - | 2M | | | |
| | | 0.001-0.10 | ▲0.12 | 3M | | | |
| | | - | - | 6M | | | |
| | | - | - | 1Y | | | |

## ≪オペ情報、入札結果≫

| | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国債補完 | 49,500億円 | 3/28 | ～ | 3/29 | (1日間) | 応札 | 1,016億円 | 落札 | 1,016億円 | -0.500% | 全 取 | 平 均 -0.500% (即) |
| 国債買入 | 4,500億円 | 3/30 | 応札 | 17,539億円 | 落札 | | 4,503億円 | 按分利回り較差 | | -0.011% | 6.4% | 平均利回り較差 -0.008% |
| 国債買入 | 400億円 | 3/30 | 応札 | 1,067億円 | 落札 | | 400億円 | 按分価格較差 | | 0.000円 | 20.0% | 平均価格較差 -0.218円 |
| CP買入 | 6,000億円 | 3/31 | 応札 | 6,449億円 | 落札 | | 5,304億円 | 全取レート | | -0.598% | | 平均落札レート -0.428% |

「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