CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/29(火)　　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想	31日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 100	▲ 200
財政		▲ 3,800	17,200	5,400
資金過不足		▲ 4,200	17,100	5,200
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 36,739		600 ▲ 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			5,100	
CP等買入		▲ 800	▲ 600	5,300
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				
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 1,000 1,100	1,000	
小計		7,500	5,500	5,300
当預増減		3,300	22,600	10,500

3/30の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,748,000	前日比	22,600
O／N	▲0.02～0.001	T／N	▲0.02～0.001	S／N	▲0.02～0.001

無担O/Nは▲0.01～0%前後での出合いが中心になると見込まれる。

≪ 29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1兆円増加の201兆9,000億円(当座預金残高見込みは272兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、昨日同様▲0.01%のオファーに対して、▲0.02%のビッドで立ち上がり、国内勢より▲0.01～0%の調達で推移した。午後に入ると、▲0.005%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。

≪ 29日のオープン市場動向 ≫

現先S/N物は概ね横ばいで推移。短国市場は、期内最終受渡日となったが、特段目立った動きはなく、3M物が▲0.12%で小額の出合いがあった程度。CP市場は、五・十日に係る発行となり大型の発行案件が散見されたが、償還総額25,000億円程度に対し発行総額は4,000億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばいでの展開となった。

≪ 30日の材料 ≫

*2月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲6.0%)

当座預金残高	2,725,400	3/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,465,300		6,700
積み終了先	2,015,800	3/30以降の残り所要積立額	
超過準備	2,015,800	積数	4,800
非準預先残高	260,100	1日平均	300
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　99.77%　(実績)　45.16%　(日数)

JGB新発10年債	
-0.090	0.005

日経平均株価(終値)	
17,103.53	▲ 30.84

為替(9時)	113.36-38
為替(5時)	113.69-70

3/28のマネタリーベース				3,724,100		
3/28コール	合計	38,217	無担	26,858	有担	11,359
コール前日増減	計	▲ 1,275	無担	▲ 1,224	有担	▲ 51

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	3/22	3/23	3/24	3/25	3/28	3/29
日銀当預残	2,655,500	2,690,500	2,690,700	2,700,400	2,722,100	2,725,400
準備預金残	2,412,400	2,436,300	2,436,800	2,436,700	2,460,100	2,465,300
レート	-0.003%	-0.004%	-0.003%	-0.007%	-0.007%	-0.006%
月中平均	-0.00155%	-0.00165%	-0.00171%	-0.00230%	-0.00246%	-0.00259%

3/29 の加重平均レート(速報)					3/28 の加重平均レート(確報)		単位 (%)
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
▲0.02 ～0.001 (▲0.006)	0.001 (0.001)			O/N	▲0.04 ～0.005 (▲0.007)		0.001 (0.001)
▲0.02 ～0.000 (▲0.012)				T/N		▲0.001 (▲0.001)	
				S/N			
0.000 (0.000)				1W		0.000 ～0.001 (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　30,000億円　3/29　～　3/30　(1日間)　応札　903億円　落札　903億円　-0.500%　全 取　平 均　-0.500%　(即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 3/31～4/7 (7日間)　応札　1億100万ドル　落札　1億100万ドル　貸付利率　0.860%

「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