

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/30(水)

◀セントラル短資株式会社▶

◀資金需給▶

単位 億円

| | 30日需給速報 | | 31日需給予想 | | 1日当社予想 | |
|---------------------------------------|---------|---------|---------|---------|--------|---------|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | ▲ 200 | ▲ 200 | ▲ 200 | ▲ 200 | 1,000 |
| 財政 | | 18,800 | 10,900 | ▲ 5,000 | | |
| 資金過不足 | | 18,600 | 10,700 | ▲ 4,000 | | |
| 貸出 | | | | | | |
| 売出手形 | | | | | | |
| 0 | | | | | | |
| 本店共通 | | | | | | |
| 0 | | | | | | |
| 全店共通 | | | | | | |
| 0 | | | | | | |
| 共通(固定) | | | | | | ▲ 1,100 |
| 36,739 | | | | | | |
| 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 | | 5,100 | | 12,200 | | |
| CP等買入 | | ▲ 600 | ▲ 8,100 | | | |
| 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 | ▲ 1,200 | | | | |
| | | 1,000 | 1,200 | | | |
| 小計 | | 4,300 | ▲ 1,600 | 11,100 | | |
| 当預増減 | | 22,900 | 9,100 | 7,100 | | |

| ◀ 3/31の日銀調節とレート予想 ▶ | | | | | |
|------------------------------------|-------------|--------|-------------|-----|-------------|
| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 2,757,400 | 前日比 | 9,100 |
| O/N | ▲0.02~0.001 | T/N | ▲0.02~0.001 | S/N | ▲0.02~0.001 |
| 無担O/Nは▲0.02~0%前後での出合いが中心になると見込まれる。 | | | | | |

◀ 30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1兆5,000億円増加の203兆4,000億円(当座預金残高見込みは274兆8,000億円)。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▲0.015~0%の調達で推移した。午後に入っても同水準での調達が散見され、本日の取引を終了した。ターム物は、ショートターム物で▲0.01%前後での出合いが散見された。3M物の共通担保オペが1兆5,000億円オファーされ、応札は0億円であった(期落ち額は1,100億円)。

◀ 30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、受渡日が新年度入りしたものの、特段動きはなく、3M物▲0.115%で少額の出合いが見られた程度。CP市場は、1日に係る発行となり、償還総額200億円程度に対し、鉄鋼・石油・機械セクター等、幅広い業態から大型の発行案件が見られ、発行総額は3,300億円程度まで膨らんだ。発行レートは0%近辺での取引が多く見られた。

◀ 31日の材料 ▶

- *2月の住宅着工統計
- *米国3月のシカゴPM景況感指数
- *ユーロ圏3月の消費者物価指数速報値
- *英国10-12月期のGDP確報値

| | | | |
|---------------------------|-------------|----------------|-------|
| 当座預金残高 | 2,748,300 | 3/30以降の残り所要積立額 | |
| 準備預金残高 | 2,485,800 | | 4,800 |
| 積み終了先 | 2,037,000 | 3/31以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 2,036,700 | 積数 | 2,800 |
| 非準備先残高 | 262,500 | 1日平均 | 200 |
| 積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数) | 2,048,000 | | |
| 準備預金進捗率 | 99.86% (実績) | 48.39% (日数) | |

| | | | | | | |
|-----------|---------|------------|----------|--------|--|-----------|
| JGB新発10年債 | | 日経平均株価(終値) | | 為替(9時) | | 112.67-68 |
| -0.095 | ▲ 0.005 | 16,878.96 | ▲ 224.57 | 為替(5時) | | 112.07-08 |

| 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 | 3/23 | 3/24 | 3/25 | 3/28 | 3/29 | 3/30 |
| 日銀当預残 | 2,690,500 | 2,690,700 | 2,700,400 | 2,722,100 | 2,725,400 | 2,748,300 |
| 準備預金残 | 2,436,300 | 2,436,800 | 2,436,700 | 2,460,100 | 2,465,300 | 2,485,800 |
| レート | -0.004% | -0.003% | -0.007% | -0.007% | -0.006% | -0.007% |
| 月中平均 | -0.00165% | -0.00171% | -0.00230% | -0.00246% | -0.00259% | -0.00273% |

| 3/30の加重平均レート(速報) | | | | 3/29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 | |
| ▲0.025 ~0.001 (▲0.007) | 0.001 | (0.001) | | O/N | ▲0.02 ~0.001 (▲0.006) | | 0.001 | (0.001) | |
| 0.000 | (0.000) | | | T/N | | ▲0.02 ~0.000 (▲0.012) | | | |
| 0.000 ~0.300 (0.006) | | | | S/N | | | | | |
| ▲0.03 ~▲0.01 (▲0.014) | | | | 1W | 0.000 | (0.000) | 0.000 | (0.000) | |
| ▲0.025 (▲0.025) | | | | 2W | | | | | |
| | | | | 3W | | | | | |
| | | | | 1M | | | | | 有担先日付分 |
| | | | | 2M | | | | | |
| | | | | 3M | | | | | |
| | | | | 6M | | | | | |
| | | | | 1Y | | | | | |

◀オペ情報、入札結果▶

| | | | | | | | | | |
|------|----------|------|------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|------|
| 全店共通 | 15,000億円 | 4/1 | ~ 7/12 (102日間) | 0億円 | 0億円 | 0.000% | 按分 | 平均 | (固定) |
| 国債補完 | 22,184億円 | 3/30 | ~ 3/31 (1日間) | 1,109億円 | 1,109億円 | -0.500% | 全取 | 平均 | (即) |
| 国債買入 | 4,000億円 | 4/1 | 応札 9,076億円 落札 4,004億円 | 按分利回り較差 | -0.008% | 89.8% | 平均利回り較差 | -0.005% | |
| 国債買入 | 4,200億円 | 4/1 | 応札 14,633億円 落札 4,203億円 | 按分利回り較差 | -0.006% | 16.4% | 平均利回り較差 | -0.003% | |
| 国債買入 | 2,400億円 | 4/1 | 応札 9,031億円 落札 2,409億円 | 按分利回り較差 | -0.014% | 25.3% | 平均利回り較差 | -0.011% | |
| 国債買入 | 1,600億円 | 4/1 | 応札 4,947億円 落札 1,601億円 | 按分利回り較差 | -0.045% | 79.2% | 平均利回り較差 | -0.028% | |

「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