

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/31(木)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	31日需給速報		1日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		0	▲ 600	2,000
財政		9,700	▲ 4,400	8,000
資金過不足		9,700	▲ 5,000	10,000
貸出				
売出手形				
本店共通				
全店共通				
共通(固定)				2,000
36,739			▲ 1,100	▲ 5,900
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			13,100	
CP等買入		5,300		
		▲ 8,100	▲ 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				
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 1,900		
		1,200	1,900	
小計		▲ 3,500	13,700	▲ 3,900
当預増減		6,200	8,700	6,100

当座預金残高	2,754,500	3/31以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,507,800		2,800
積み終了先	2,052,300	4/1以降の残り所要積立額	
超過準備	2,051,400	積数	1,400
非準備先残高	246,700	1日平均	100
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	2,057,100		
準備預金進捗率	99.93% (実績)	51.61% (日数)	

3/30のマネタリーベース		3,750,900	
3/30コール 合計	39,694 無担	28,376 有担	11,318
コール前日増減	計 ▲ 53 無担	▲ 267 有担	214

3/31の加重平均レート(速報)				3/30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	
▲0.015 ~0.001 (▲0.002)	0.001	(0.001)		▲0.025 ~0.001 (▲0.007)		0.000	(0.000)	0.001	(0.001)
▲0.005 (▲0.005)									
▲0.015 ~0.050 (▲0.006)				1W 0.000	(0.000)	▲0.01 ~0.300 (0.000)			
				2W		▲0.03 ~▲0.01 (▲0.014)			
				3W					
▲0.025 (▲0.025)		0.001-0.10	-	1M		▲0.025 (▲0.025)		有担先日付分	
		0.001-0.10	-	2M					
		0.001-0.10	-	3M					
		-	-	6M					
		-	-	1Y					

《オペ情報、入札結果》

全店共通	8,000億円	4/4 ~ 4/18 (14日間)	応札	1,950億円	落札	1,950億円	0.000%	全取	平均	0.000% (固定)
国債補完	67,004億円	3/31 ~ 4/1 (1日間)	応札	1,828億円	落札	1,828億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)

「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

今年度はありがとうございました。来年度もよろしくお願い申し上げます。

4/1の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,763,200	前日比	8,700
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。

《 31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204兆9,000億円(当座預金残高見込みは275兆7,000億円)。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0~0.001%での出合い。一巡後は国内勢より▲0.015~0.001%の調達で推移した。午後は閑散で、年度末の取引を終了した。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。2W物の共通担保オペが8,000億円オファーされ、落札総額1,950億円の結果となった。

《 31日のオープン市場動向 》

現貨S/N物は横ばい圏で推移。短国市場は、ポジション調整の動きが多少見られた程度で、終日閑散となった。CP市場は、鉄鋼・石油業態から大型の発行案件が見られ、全体の発行総額は1,100億円程度まで膨らんだ。発行レートは引き続き0%近辺での動きとなった。

《 1日の材料 》

*3月調査の日銀短観(概要及び要旨)
 市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+8
 *電力小売全面自由化
 *米国2月の建設支出 *米国3月の雇用統計
 *米国3月のISM製造業景況指数

《コール3月の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	-0.00271%	有担 0.00100%
(営業日のみ)	無担	-0.00273%	有担 0.00100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	112.39-40
-0.050	0.045	16,758.67	▲ 120.29	為替(5時)	112.42-44

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	3/24	3/25	3/28	3/29	3/30	3/31
日銀当預残	2,690,700	2,700,400	2,722,100	2,725,400	2,748,300	2,754,500
準備預金残	2,436,800	2,436,700	2,460,100	2,465,300	2,485,800	2,507,800
レート	-0.003%	-0.007%	-0.007%	-0.006%	-0.007%	-0.002%
月中平均	-0.00171%	-0.00230%	-0.00246%	-0.00259%	-0.00273%	-0.00271%