

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/2/29(月)

《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		1日需給予想		2日当予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 200		0		1,000
財政		3,600		▲ 7,200		▲ 42,000
資金過不足		3,400		▲ 7,200		▲ 41,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		700				
58,669		▲ 1,300				
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入				7,500		
国庫短期証売却						
国債買入				6,000		12,600
CP等買入		4,000				
		▲ 3,100		▲ 300		
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 271,714						
被災地支援						
3,144						
社債等買入				▲ 100		
ETF買入		300				
国債補完供給						
小計		600		13,100		12,600
当預増減		4,000		5,900		▲ 28,400

《 3/1の日銀調節とレート予想 》

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,595,800	前日比	5,900
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。

《 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、前営業日比5,000億円増の190兆円(当座預金残高見込みは259兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.01~0%オフアーに対し、▲0.02%ビッドで始まった。その後、国内勢より▲0.001~0.001%での調達が見られ午前の取引を終えた。午後は、閑散としたなか本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームでの出合いが見られた。

《 29日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは引き続き低水準で推移した。短国市場は3M物で▲0.10%の出合いが散見された程度で、動意無く閑散だった。C P市場は償還総額1,300億円程度に対し、発行案件が少なく、発行総額は200億円程度と閑散だった。発行レートは引き続き極めて低い水準で推移した。

《 1日の材料 》

- *1月の完全失業率(市場予想: 3.3%)
- *1月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比▲2.7%)
- *1月の有効求人倍率(市場予想: 1.27倍)
- *10~12月期の法人企業統計調査季報
- *米国1月の建設支出
- *米国2月のISM製造業景況指数
- *米国スーパーチューズデー(米国集中選挙日)
- *10年利付国債入札(24,000億円、3/22発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、3/9借入)

《コール2月の加重平均レート》

(土日を含む)	無担	0.03379%	有担	0.01652%
(営業日のみ)	無担	0.03250%	有担	0.01600%

当座預金残高	2,589,900	2/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,346,000		5,700
積み終了先	1,901,500	3/1以降の残り所要積立額	
超過準備	1,900,800	積数	4,100
非準備先残高	243,900	1日平均	300
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,917,300		
準備預金進捗率	99.79% (実績)	48.28%	(日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	113.72-74
-0.065	0.000	16,026.76	▲ 161.65
		為替(5時)	112.98-00

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	2/22	2/23	2/24	2/25	2/26	2/29
日銀当預残	2,550,900	2,584,200	2,582,100	2,575,100	2,585,900	2,589,900
準備預金残	2,320,500	2,350,100	2,351,800	2,341,200	2,334,900	2,346,000
レート	-0.001%	-0.001%	-0.003%	-0.003%	-0.002%	-0.001%
月中平均	0.04518%	0.04317%	0.04125%	0.03948%	0.03504%	0.03379%

2/29の加重平均レート(速報)				2/26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	
▲0.01 ~ 0.010 (▲0.001)	0.001	(0.001)		▲0.04 ~ 0.001 (▲0.002)		▲0.005 ~ 0.000 (▲0.004)		0.001	(0.001)
▲0.005 ~ 0.000 (▲0.004)									
				1W	▲0.01 (▲0.010)	▲0.01 ~ 0.300 (0.012)			
▲0.005 ~ 0.280 (0.043)				2W					
				3W					
				1M				有担先日付分	
			0.001-0.10	-					
			0.001-0.10	-					
			0.001-0.10	▲0.10					
			-	-					
			-	-					
			-	-					
			-	-					

《オペ情報、入札結果》

国債買入	4,000億円	3/2	応札	7,136億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	-0.009%	33.3%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	4,200億円	3/2	応札	9,997億円	落札	4,202億円	按分利回り較差	-0.011%	17.3%	平均利回り較差	-0.007%
国債買入	2,600億円	3/2	応札	5,322億円	落札	2,601億円	按分利回り較差	-0.012%	6.7%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	1,800億円	3/2	応札	4,420億円	落札	1,800億円	按分利回り較差	0.000%	0.6%	平均利回り較差	0.005%

成長基盤強化(本則第23回) 3/4~2020/3/4 (1461日間) 貸付予定総額 6,299億円 貸付利率 0% 貸付先数 54先

成長基盤強化(本則第15回の借り換え) 3/4~2017/3/3 (364日間) 貸付予定総額 552億円 貸付利率 0% 貸付先数 43先

成長基盤強化(本則第11回の借り換え) 3/4~2017/3/3 (364日間) 貸付予定総額 210億円 貸付利率 0% 貸付先数 37先

成長基盤強化(出資等特則第19期) 3/7~2020/3/6 (1460日間) 貸付予定総額 100億円 貸付利率 0% 貸付先数 1先

成長基盤強化(出資等特則第11期の借り換え) 3/7~2018/3/6 (729日間) 貸付予定総額 9億円 貸付利率 0% 貸付先数 3先

成長基盤強化(小口第16期) 3/4~2020/3/4 (1461日間) 貸付予定総額 12.57億円 貸付利率 0% 貸付先数 14先

成長基盤強化(小口第8期の借り換え) 3/4~2017/3/3 (364日間) 貸付予定総額 3.17億円 貸付利率 0% 貸付先数 8先

成長基盤強化(小口第4期の借り換え) 3/4~2017/3/3 (364日間) 貸付予定総額 1.03億円 貸付利率 0% 貸付先数 4先

成長基盤強化(米ドル特則第15期) 3/4~2017/3/3 (364日間) 貸付予定総額 220百万ドル 貸付先数 15先

成長基盤強化(米ドル第11期の借り換え) 3/4~2017/3/3 (364日間) 貸付予定総額 9百万ドル 貸付先数 8先

成長基盤強化(米ドル第7期の借り換え) 3/4~2017/3/3 (364日間) 貸付予定総額 1,389百万ドル 貸付先数 24先

成長基盤強化(米ドル第3期の借り換え) 3/4~2017/3/3 (364日間) 貸付予定総額 983百万ドル 貸付先数 11先

「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