CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2016/3/7(月)　　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,100	1,000	0
財政		▲ 4,100	3,500	2,000
資金過不足		▲ 3,000	4,500	2,000
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 58,409		200 ▲ 500		
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			13,700	
CP等買入		▲ 700	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 63,567 (増加) 271,714		100 ▲ 100		
被災地支援 3,144				
社債等買入				
ETF買入			100	
国債補完供給	即日	▲ 200	200	
小計		▲ 1,200	21,400	0
当預増減		▲ 4,200	25,900	2,000

当座預金残高	2,557,500	3/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,317,300		400
積み終了先	1,882,300	3/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,882,300	積数	300
非準預先残高	240,200	1日平均	0
積み期間(2/16～3/15)の所要準備額(積数)			1,922,800

準備預金進捗率　99.98%　(実績)　72.41%　(日数)

3/4のマネタリーベース				3,560,000		
3/4コール	合計	59,517	無担	43,832	有担	15,685
コール前日増減	計	87	無担	▲ 21	有担	108

≪ 3/8の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,583,400	前日比	25,900
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。

≪ 7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6,000億円増の187兆9,000億円(当座預金残高見込みは、255兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、先週と同様、▲0.01%のオファーに対し、▲0.02%のビッドで始まった。その後、国内勢より▲0.01～0.001%での調達が見られ午前の取引を終えた。午後に入ると、0～0.001%での出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で0%前後での出合いが散見された。

≪ 7日のオープン市場動向 ≫

短国現先レートS/Nは引き続き低水準のレート気配だった。短国アウトライト市場はイベントが無く閑散で、4月償還の銘柄で小額の出合いが見られた程度にとどまった。CP市場は償還総額1,100億円程度に対し、発行総額は500億円程度と少な目だった。発行レートは引き続き低く、最上格の期越物では、ほぼ0%に近い水準での約定も見られた。CP等買入オペは5,000億円でオファーされた。按分レート▲0.198%で按分比率62.9%、平均レート▲0.109%と前回比で按分が上昇し、平均が低下する結果となった(前回按分▲0.298%　平均▲0.037%)。

≪ 8日の材料 ≫

*10-12月期のGDP2次速報(市場予測:前期比年率▲1.5%)
*1月の国際収支
*2月の景気ウオッチャー速報
*2月の消費動向調査
*ユーロ圏10-12月期のGDP改定値
*国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、3/10発行)
*30年利付国債入札(8,000億円、3/22発行)

≪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%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	113.82-85
-0.050	▲ 0.010	16,911.32	▲ 103.46	為替(5時)	113.71-73

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	2/29	3/1	3/2	3/3	3/4	3/7
日銀当預残	2,589,900	2,592,700	2,553,700	2,549,600	2,561,700	2,557,500
準備預金残	2,346,000	2,337,000	2,300,300	2,305,100	2,313,800	2,317,300
レート	-0.001%	-0.003%	-0.002%	-0.002%	-0.001%	-0.001%
月中平均	0.03379%	-0.00300%	-0.00250%	-0.00233%	-0.00167%	-0.00157%

3/7 の加重平均レート(速報)

無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国	
▲0.01 ～0.001 (▲0.001)	0.001 (0.001)			O/N
0.000 ～0.001 (0.001)				T/N
				S/N
0.000 ～0.001 (0.000)				1W
0.000 (0.000)				2W
				3W
		0.001-0.10	▲0.15	1M
		0.001-0.10	-	2M
		0.001-0.10	-	3M
		-	-	6M
		-	-	1Y

3/4 の加重平均レート(確報)　単位(%)

無担当日分	無担先日付分	有担当日分
▲0.03 ～0.001 (▲0.001)		0.001 (0.001)
	0.000 ～0.001 (0.001)	
0.000 (0.000)	0.000 ～0.300 (0.015)	
		有担先日付分

≪オペ情報、入札結果≫

国債補完	25,986億円	3/7	～	3/8	(1日間)	応札	107億円	落札	107億円	-0.500%	全 取	平 均	-0.500% (即)
国債補完	5,986億円	3/7	～	3/8	(1日間)	応札	69億円	落札	69億円	-0.500%	全 取	平 均	-0.500% (即)
CP買入	5,000億円	3/10	応札	7,573億円	落札	5,000億円	按分レート	-0.198%	62.9%	平均落札レート	-0.109%		

「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