

Central Daily Market Report

2016年4月1日(金)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2016年4月1日 需給速報	2016年4月4日 需給予想	2016年4月5日 当社予想
銀行券	▲ 600	1,600	1,000
財政	▲ 4,700	▲ 5,000	4,000
資金過不足	▲ 5,300	▲ 3,400	5,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		▲ 1,100	2,000
国債買現			▲ 5,900
国庫短期証買入			
国債買入	13,100		5,200
CP等買入		▲ 200	▲ 100
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 2,100	1,900	2,100
当預増減	6,300	▲ 5,300	10,200
当座預金残高	2,760,800	2,755,500	2,765,700
準備預金残高	2,491,000		
積み終了先	2,043,300		4/4以降の残り所要積立額
超過準備	2,043,000		積数
非準備預金先	269,800		1日平均
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			2,057,100
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			61.29%

●2016年4月1日の市場動向

<インターバンク市場>

午前8時発表の準備預金残高見込みは、前日比5,000億円増加の205兆4,000億円(当座預金残高見込みは276兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、▲0.015%のオファーに対して、▲0.03%のビッドで始まった。立ち上がりは、▲0.015~▲0.01%での出会い。年度末要因の剥落で資金運用サイドの厚みが再度増し、昨日対比でレートが低下した。一巡後は▲0.01~0%の出会いで推移した。ターム物は、証券業態からの調達案件が散見された。

<レポ市場>

GC T/N(4/4-4/5)は▲0.095~▲0.090%程度での出会い。S/N(4/5-4/6)は▲0.095~▲0.090%程度での出会い。SCは個別銘柄では10Y335~342、5Y123~127、20Y153~156、30Y48~50などにビッドが多い。

<短国市場>

現先S/N物は横ばい圏で推移。カレンダーベースで期明けとなったものの、3M物で▲0.115%の少額出会いが見られた程度であった。

<CP市場>

五・十日にかかる発行となり、自動車・商社・ノンバンク業態から大型の発行案件が見られ、全体の発行総額は2,200億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいでの展開となった。

●短期金融市場関連指標

2016/4/1	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.015	0.001	▲ 0.006			0.001	-	▲ 0.102
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.091
S/N							-	-
1W	▲ 0.005	0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.107
2W	▲ 0.015	0.050	0.013				-	▲ 0.106
3W							-	▲ 0.111
1M							-	▲ 0.120
3M							▲ 0.119	▲ 0.139
6M							▲ 0.152	▲ 0.160
1Y							▲ 0.200	▲ 0.172

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
▲ 0.066	▲ 0.016	16,164.16	▲ 594.51	112.51-53	112.27-29

日付	3/25	3/28	3/29	3/30	3/31
日銀当預残	2,700,400	2,722,100	2,725,400	2,748,300	2,754,500
準備預金残	2,435,400	2,460,100	2,465,300	2,485,800	2,507,800
マネタリーベース	3,702,400	3,724,100	3,727,800	3,750,900	3,757,000
無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.007%	▲0.006%	▲0.007%	▲0.002%
コール市場残高	39,492	38,217	39,747	39,694	29,724
うち無担	28,082	26,858	28,643	28,376	19,540
うち有担	11,410	11,359	11,104	11,318	10,184

●入札結果

名称	回号	表面 利率	発行 予定額	発行日	償還日	応募額 (億円)	募入 最低額	募入 最高利回	案分率	募入 平均価格	募入 平均利回	第1非価格 競争入札 (億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。												

●オペ結果

種類	オファー額 (億円)	スタート日	エンド日	貸付 利率	応札総額 (億円)	落札総額 (億円)	按分レート ・利回較差 ・価格較差	全取レート ・利回較差 ・価格較差	平均落札レート ・利回較差 ・価格較差	按分 比率
国債買入(残存期間1年以下)	700	2016/4/5			4,638	701	0.024		0.058	23.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2016/4/5			12,788	4,503	0.006		0.012	33.4
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	84,285	2016/4/1	2016/4/4		1,879	1,879		▲0.500	▲0.500	

●2016年4月4日の予定

- *3月のマネタリーベース
- *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み
- *2月の米製造業新規受注・出荷・在庫
- *3月のFRB 労働市場情勢指数

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何らかの取引を誘引することを目的としたものではありません。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