

# Central Daily Market Report

2016年4月4日(月)

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4日		2016年4月5日		2016年4月6日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	1,700	900			1,000	
財政	▲ 4,000	400			2,000	
資金過不足	▲ 2,300	1,300			3,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通	2,000	▲ 5,900				
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			5,300		11,900	
CP等買入		▲ 100		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 1,400	2,100		1,400		
当預増減	▲ 5,600		7,200		14,900	
当座預金残高	2,755,200		2,762,400		2,777,300	
準備預金残高	2,486,900					
積み終了先	2,040,000			4/5以降の残り所要積立額		
超過準備	2,040,000			積数	300	
非準備預金先	268,300			1日平均	0	
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	64.52%		

## ●2016年4月4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9,000億円減少の204兆5,000億円(当座預金残高見込みは275兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、▲0.01%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、▲0.01%での出会い。一日を通してマイナス圏での取引が中心になり、一巡後は▲0.015~0%のレンジでの出会いが見られた。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(4/5-4/6)は▲0.095~▲0.085%程度での出会い。S/N(4/6-4/7)は▲0.105~▲0.09%程度での出会い。SCは個別銘柄では10Y335~342、5Y123~127、20Y153~156、30Y47~50などにビッドが多い。

### <短国市場>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。5日以降に入札が連続で予定されていることから全般的に様子見姿勢が強く、3M物において▲0.105%での小額の出合いがみられた程度であった。

### <CP市場>

石油業態において大型案件があり、償還総額150億円に対して発行総額は300億円まで膨らんだものの、案件数は少なく閑散とした地合いとなった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2016/4/4	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.015	0.001	▲ 0.007			0.001	-	▲ 0.096	▲ 0.085	▲ 0.019	16,123.27	▲ 40.89	111.67-69	111.58-60
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.013				-	▲ 0.105						
2W			0.030				-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.112						
1M	0.005	0.120	0.073				-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.116	▲ 0.139						
6M							▲ 0.150	▲ 0.160						
1Y							▲ 0.190	▲ 0.172						
									日付	3/28	3/29	3/30	3/31	4/1
									日銀当預残	2,722,100	2,725,400	2,748,300	2,754,500	2,760,800
									準備預金残	2,460,100	2,465,300	2,485,800	2,507,800	2,491,000
									マネタリーベース	3,724,100	3,727,800	3,750,900	3,757,000	3,764,000
									無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.006%	▲0.007%	▲0.002%	▲0.006%
									コール市場残高	38,217	39,747	39,694	29,724	40,440
									うち無担	26,858	28,643	28,376	19,540	29,450
									うち有担	11,359	11,104	11,318	10,184	10,990

## ●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	棄分率	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年超3年以下)	3,500	2016/4/6			8,352	3,501	▲0.014		▲0.009	94.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/4/6			13,534	4,402	▲0.004		0.003	35.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,200	2016/4/6			7,215	2,201	▲0.017		▲0.011	65.3
国債買入(残存期間25年超)	1,800	2016/4/6			5,681	1,801	▲0.049		▲0.033	56.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	31,532	2016/4/4	2016/4/5		1,228	1,228		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年4月5日の予定

*4月の日銀当座預金増減要因見込み	国庫短期証券(598回)入札
*2月の毎月勤労統計調査速報	(3ヶ月、44,000億円、4/7発行)
*2月の米貿易収支	10年利付国債入札
*3月のISM非製造業景況指数	(24,000億円、4/7発行)

◆本資料は信頼できると思わ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