

Central Daily Market Report

2016年4月5日(火)

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5日		2016年4月6日		2016年4月7日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	1,100		1,000		0	
財政	▲200		3,400		▲21,000	
資金過不足	900		4,400		▲21,000	
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						
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,300		13,200			
CP等買入		▲800		▲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						
ETF買入						
国債補完供給	▲1,000	1,400		1,000		
当預増減	5,800		18,500		▲21,000	
当座預金残高	2,761,000		2,779,500		2,758,500	
準備預金残高	2,492,400					
積み終了先	2,045,100				4/6以降の残り所要積立額	
超過準備	2,045,100				積数	300
非準備預金先	268,600				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	67.74%		

●2016年4月5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、前日比横ばいの204兆5,000億円(当座預金残高見込みは276兆2,000億円)。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、▲0.015~▲0.005%での出会い。一日を通して資金調達サイドの参加者が乏しく、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、出会い少なく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/N(4/6-4/7)は▲0.10~▲0.095%程度での出会い。S/N(4/7-4/8)は▲0.09~▲0.085%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。本日は新発3M物の入札が実施された。WI取引では▲0.100~▲0.097%の出会いが見られた。入札結果は平均落札利回▲0.0949%、按分落札利回▲0.0850%となった。短国入札が今週にまだ二回控えている事もあってか、慎重な応札姿勢が反映された概ね事前予想通りの結果であった。セカンダリーでは、▲0.090~▲0.088%での取引が見られた。

<CP市場>

商社、鉄鋼業態等より大型発行案件が実施され、100億円強程の償還総額に対して、1,300億円程の発行が見られる発行超のマーケットとなった。玉確保ニーズの底堅い地合いに変化は無く、発行レートは0%近傍に張り付く展開となった。

●短期金融市場関連指標

2016/4/5	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	
	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)	為替(17時)
単位：%							売買参考統計値	平均値	▲0.070	0.015	15,732.82	▲390.45	111.22-24	110.45-48
O/N	▲0.020	0.001	▲0.007			0.001	-	▲0.093						
T/N	▲0.010	▲0.005	▲0.008				-	▲0.097						
S/N							-	-						
1W	▲0.015	0.110	▲0.005				-	▲0.105						
2W							-	▲0.106						
3W							-	▲0.110						
1M			▲0.040				-	▲0.122						
3M							▲0.090	▲0.138						
6M							▲0.148	▲0.160						
1Y							▲0.182	▲0.172						
									日付	3/29	3/30	3/31	4/1	4/4
									日銀当預残	2,725,400	2,748,300	2,754,500	2,760,800	2,755,200
									準備預金残	2,465,300	2,485,800	2,507,800	2,491,000	2,486,900
									マネタリーベース	3,727,800	3,750,900	3,757,000	3,764,000	3,756,700
									無担O/N加重平均	▲0.006%	▲0.007%	▲0.002%	▲0.006%	▲0.007%
									コール市場残高	39,747	39,694	29,724	40,440	39,681
									うち無担	28,643	28,376	19,540	29,450	28,965
									うち有担	11,104	11,318	10,184	10,990	10,716

●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)
国庫短期証券	598	-	43,500	2016/4/7	2016/7/4	148,871.0	40,172.6	100.0205	▲0.0850%	40.0205%	100.0229	▲0.0949%	3,327.2
10年利付国債	342	0.10%	21,846	2016/4/7	2026/3/20	84,954.0	21,846.0	101.6500	▲0.0640%	29.7153%	101.7000	▲0.0690%	2,138.0

●オペ結果

注：米ドル供給オペの単位は百万ドル

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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	57,381	2016/4/5	2016/4/6		879	879		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/4/7	2016/4/14	0.86	0	0				

●2016年4月6日の予定

*2月の景気動向指数速報(内閣府 14:00) 国庫短期証券(599回)入札(6ヶ月、35,000億円、4/11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