# Central Daily Market Report

2016年4月6日（水）
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6日 需給速報 | | 2016年4月7日 需給予想 | | 2016年4月8日 当社予想 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 銀行券 | 1,000 | | 200 | | 0 | |
| 財政 | 3,600 | | ▲ 22,500 | | ▲ 2,000 | |
| 資金過不足 | 4,600 | | ▲ 22,300 | | ▲ 2,000 | |
| 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 | 13,200 | | | | 12,400 | |
| CP等買入 | | ▲ 100 | | ▲ 300 | | |
| 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 | ▲ 800 | 1,000 | | 800 | | |
| 当預増減 | 17,900 | | ▲ 21,800 | | 10,400 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 当座預金残高 | 2,778,900 | 2,757,100 | 2,767,500 |
| 準備預金残高 | 2,505,900 | | |
| 積み終了先 | 2,057,800 | | |
| 超過準備 | 2,057,800 | | |
| 非準備預金先 | 273,000 | | |

| 4月7日以降の残り所要積立額 | |
|---|---|
| 積数 | 200 |
| 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 | 70.97% |

## ●2016年4月6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2兆3,000億円増加の206兆8,000億円(当座預金残高見込みは278兆円)。朝方の無担O/Nは、▲0.015%のオファーに対して、▲0.02%のビッドで始まった。立ち上がりは、▲0.015～▲0.01%での出合い。▲0.01%近辺ではオファーに厚みが見られ、レートが上昇し辛くなっている。一巡後は▲0.015～0%のレンジでの出合いで推移した。ターム物については、一部の出し手から積極的な運用ニーズが見られているものの、調達サイドが少なく、閑散な地合いであった。

**<レポ市場>**

GC T/N(4/7-4/8)は▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/N(4/8-4/11)は▲0.10～▲0.095%程度での出合い。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。短国6M物の入札が行われた。WI取引での出合いは無く、▲0.15～▲0.13%程度での気配の中、入札結果は平均落札利回▲0.1713%、按分落札利回▲0.1574%と強めの結果となった。セカンダリーでは、一時、6M物が▲0.32%で買われる場面もあり、全般的にオペをにらんだ展開となった。

**<CP市場>**

五・十日発行となり、商社・石油業態において大型案件があったため、償還総額150億円に対して発行総額は1,500億円まで膨らんだ。期間の長さに関わらず投資家のニーズは強く、底堅い地合いとなった。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

| 2016/4/6 | 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 | ▲ 0.007 | | | 0.001 | － | ▲ 0.089 |
| T/N | ▲ 0.015 | ▲ 0.010 | ▲ 0.013 | | | | － | ▲ 0.088 |
| S/N | | | | | | | － | － |
| 1W | ▲ 0.030 | 0.117 | 0.017 | | | | － | ▲ 0.105 |
| 2W | | | | | | | － | ▲ 0.106 |
| 3W | | | | | | | － | ▲ 0.110 |
| 1M | | | ▲ 0.040 | | | | － | ▲ 0.121 |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.094 | ▲ 0.140 |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.226 | ▲ 0.160 |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.186 | ▲ 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) |
| ▲ 0.065 | 0.005 | 15,715.36 | ▲ 17.46 | 110.38-40 | 110.40-42 |

| 日付 | 3/30 | 3/31 | 4/1 | 4/4 | 4/5 |
|---|---|---|---|---|---|
| 日銀当預残 | 2,748,300 | 2,754,500 | 2,760,800 | 2,755,200 | 2,761,000 |
| 準備預金残 | 2,485,800 | 2,507,800 | 2,491,000 | 2,486,900 | 2,492,400 |
| マネタリーベース | 3,750,900 | 3,757,000 | 3,764,000 | 3,756,700 | 3,761,400 |
| 無担O/N加重平均 | ▲0.007% | ▲0.002% | ▲0.006% | ▲0.007% | ▲0.007% |
| コール市場残高 | 39,694 | 29,724 | 40,440 | 39,681 | 40,861 |
| うち無担 | 28,376 | 19,540 | 29,450 | 28,965 | 30,548 |
| うち有担 | 11,318 | 10,184 | 10,990 | 10,716 | 10,313 |

## ●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Ｉ非価格競争入札(億円) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国庫短期証券 | 599 | － | 35,000 | 2016/4/11 | 2016/10/11 | 160,792.0 | 31,950.8 | 100.0790 | ▲0.1574% | 44.2422% | 100.0860 | ▲0.1713% | 3,049.0 |

## ●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 | 2016/4/8 | | | 8,032 | 3,505 | ▲0.019 | | ▲0.014 | 11.8 |
| 国債買入（残存期間3年超5年以下） | 4,400 | 2016/4/8 | | | 13,657 | 4,408 | ▲0.010 | | ▲0.008 | 75.5 |
| 国債買入（残存期間5年超10年以下） | 4,500 | 2016/4/8 | | | 12,809 | 4,506 | ▲0.008 | | ▲0.006 | 99.3 |
| 国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分） | 31,824 | 2016/4/6 | 2016/4/7 | | 755 | 755 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |
| 国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分） | 236 | 2016/4/6 | 2016/4/7 | | 10 | 10 | | ▲0.500 | ▲0.500 | |
| CP等買入 | 2,500 | 2016/4/11 | | | 7,072 | 2,500 | ▲0.045 | | ▲0.021 | 28.6 |

## ●2016年4月7日の予定

*日銀支店長会議 さくらレポート
（＝地域経済報告）
*3月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*2月の米消費者信用残高

国庫短期証券（600回）入札
（3ヶ月、44,000億円、4/11発行）
流動性供給
（4,000億円、4/11発行）

交付税特別会計借入
（10,500億円、4/15借入）

◆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