

Central Daily Market Report

2016年4月7日(木)

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7日		2016年4月8日		2016年4月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	300		100		1,000	
財政	▲ 23,000		6,200		▲ 31,000	
資金過不足	▲ 22,700		6,300		▲ 30,000	
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					600	▲ 1,500
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,700			
CP等買入		▲ 300		▲ 500	2,500	
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	▲ 600	800		600		
当預増減	▲ 22,800		19,100		▲ 28,400	
当座預金残高	2,756,100		2,775,200		2,746,800	
準備預金残高	2,487,400					
積み終了先	2,039,900		4月8日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,039,900		積数		200	
非準備預金先	268,700		1日平均		0	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					2,072,100	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	74.19%		

●2016年4月7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2兆8,000億円減少の204兆円(当座預金残高見込みは275兆7,000億円)。朝方の無担O/N物は、▲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、▲0.01%近辺での出会い。昨日までと同様、取り手優位の展開で、一巡後は▲0.01~0.001%のレンジでの出会いで推移した。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、出会い辛い状況が続いている。本日の固定金利方式による共通担保資金供給オペは、2W物8,000億円のオファーに対し、落札額580億円(期落ち額1,480億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(4/8-4/11)は▲0.10~▲0.09%程度のお合い。S/N(4/11-4/12)は短国発行に伴った業者のファンディングニーズから、▲0.09~▲0.06%程度での出会いとなった。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。新発3M物の入札が実施された。WI取引では▲0.11%での出合となった。入札結果は平均落札利回▲0.1214%、按分落札利回▲0.1082%となった。午後はオペを睨んだ取引が見られ、3M▲0.50%、6M▲0.35~▲0.22%での出会いとなった。

<CP市場>

鉄鋼業態等より超大型の発行案件が実施され、650億円程度の償還総額に対して、1,700億円程の発行が見られる発行超のマーケットとなった。入札状況に特段の変化は無く、底堅い地合が継続しており、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

2016/4/7	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	-	▲ 0.094	▲ 0.060	0.005	15,749.84	34.48	109.72-73	108.56-58
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.117	▲ 0.002				-	▲ 0.105						
2W							-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.500	▲ 0.144						
6M							▲ 0.267	▲ 0.162						
1Y							▲ 0.189	▲ 0.174						
									日付	3/31	4/1	4/4	4/5	4/6
									日銀当預残	2,754,500	2,760,800	2,755,200	2,761,000	2,778,900
									準備預金残	2,507,800	2,491,000	2,486,900	2,492,400	2,505,900
									マネタリーベース	3,757,000	3,764,000	3,756,700	3,761,400	3,778,400
									無担O/N加重平均	▲0.002%	▲0.006%	▲0.007%	▲0.007%	▲0.007%
									コール市場残高	29,724	40,440	39,681	40,861	39,996
									うち無担	19,540	29,450	28,965	30,548	29,357
									うち有担	10,184	10,990	10,716	10,313	10,639

●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・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	600	-	43,500	2016/4/11	2016/7/11	203,949.0	40,040.7	100.0270	▲0.1082%	1.5359%	100.0303	▲0.1214%	3,459.0
流動性供給	211	-	4,000	2016/4/11		10,474.0	3,985.0		▲0.0110%	49.5016%		▲0.0190%	
交付税特会	-	-	10,500	2016/4/15	2016/10/14	96,360.0	10,500.0		0.0010%	10.8967%		0.0010%	

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2016/4/11	2016/4/25		580	580				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	31,076	2016/4/7	2016/4/8		583	583		▲0.500	▲0.500	

●2016年4月8日の予定

*2月の国際収支
*3月の消費動向調査
*3月の景気ウォッチャー調査
*2月の米卸売売上高

◆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