

# Central Daily Market Report

2016年4月8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8日		2016年4月11日		2016年4月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	100		1,600		1,000	
財政	6,200		▲ 30,500		2,000	
資金過不足	6,300		▲ 28,900		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			600	▲ 1,500		
国債買現						
国庫短期証買入					17,500	
国債買入	12,700				4,700	
CP等買入		▲ 500	2,500	▲ 400		
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	▲ 1,300	600		1,300		
当預増減	17,800		▲ 26,400		25,200	
当座預金残高	2,773,900		2,747,500		2,772,700	
準備預金残高	2,498,900					
積み終了先	2,051,800			4月11日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,051,800			積数	100	
非準備預金先	275,000			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	100.00%		日数	83.87%	

## ●2016年4月8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1兆9,000億円増加の205兆9,000億円(当座預金残高見込みは277兆5,000億円)。朝方の無担O/N物は、▲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%近辺での出会い。昨日に引き続き資金運用ニーズが強く、一巡後は▲0.015~▲0.01%での出会いを中心に推移した。ターム物は、出し取り共に動意が見られず、閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/N(4/11-4/12)は▲0.075~▲0.065%程度での出会い。S/N(4/12-4/13)は、短国買入オベが通知されたものの、投資家の資金調達ニーズが強く▲0.08~▲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、30Y46~50などにビッドが多い。

### <短国市場>

現先S/N物は低位横ばい圏で推移した。アウトライト市場は短国買入オベが17,500億円と市場予想よりもやや少なめでオファーされ、結果は、平均利回較差+0.053%、按分利回較差▲0.014%となった。応募限度額がオファー額の4分の1に設定された影響もあってか、平均と按分は大きく乖離する結果となった。

### <CP市場>

一部の卸売業態等より大型の発行案件が実施されたものの、償還総額1,000億円程に対して発行総額は400億円程度と、償還超の閑散としたマーケットとなった。引続き、投資家の購入意欲は強く、発行レートは低い水準で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2016/4/8	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.040	0.001	▲ 0.012			0.001	-	▲ 0.091	▲ 0.085	▲ 0.025	15,821.52	71.68	108.46-49	109.06-08		
T/N	▲ 0.015	0.000	▲ 0.004				-	▲ 0.070								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.016				-	▲ 0.108								
2W							-	▲ 0.111								
3W							-	▲ 0.117								
1M							-	▲ 0.130								
3M							▲ 0.479	▲ 0.149								
6M							▲ 0.260	▲ 0.167								
1Y							▲ 0.191	▲ 0.178								
											日付	4/1	4/4	4/5	4/6	4/7
											日銀当預残	2,760,800	2,755,200	2,761,000	2,778,900	2,756,100
											準備預金残	2,491,000	2,486,900	2,492,400	2,505,900	2,487,400
											マネタリーベース	3,764,000	3,756,700	3,761,400	3,778,400	3,755,300
											無担O/N加重平均	▲0.006%	▲0.007%	▲0.007%	▲0.007%	▲0.007%
											コール市場残高	40,440	39,681	40,861	39,996	40,749
											うち無担	29,450	28,965	30,548	29,357	30,533
											うち有担	10,990	10,716	10,313	10,639	10,216

## ●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	衆分率	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
国庫短期証券買入	17,500	2016/4/12			27,789	17,500	▲0.014		0.053	57.0
国債買入(残存期間1年以下)	700	2016/4/12			3,801	702	0.008		0.008	82.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,200	2016/4/12			6,688	2,200	▲0.007		0.002	48.9
国債買入(残存期間25年超)	1,800	2016/4/12			5,718	1,804	0.003		0.012	35.4
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	11,000	2016/4/8	2016/4/11		1,231	1,231		▲0.500	▲0.500	

## ●2016年4月11日の予定

- \*第91回信託大会にて黒田総裁講演
- \*2月の機械受注統計  
(市場予想：除船電、前月比▲12.4%)

◆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