Central Daily Market Report

2016年4月11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11日 需給速報		2016年4月12日 需給予想		2016年4月13日 当社予想	
銀行券	1,600		700		0	
財政	▲ 31,300		2,000		2,000	
資金過不足	▲ 29,700		2,700		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	600	▲ 1,500				
国債買現						
国庫短期証買入			17,500			
国債買入			5,400			
CP等買入	2,500	▲ 400		▲ 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			300			
国債補完供給	▲ 700	1,300		700		
当預増減	▲ 27,900		26,300		2,000	

当座預金残高	2,746,000	2,772,300	2,774,300
準備預金残高	2,479,200		
積み終了先	2,034,200		
超過準備	2,034,200		
非準備預金先	266,800		

4月12日以降の残り所要積立額	
積数	100
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 87.10%

●2016年4月11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2兆4,000億円減少の203兆5,000億円(当座預金残高見込みは274兆8,000億円)。朝方の無担O/N物は、▲0.01%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%近辺での出合い。積み最終日が近づいてきたことで様子見姿勢を取る金融機関が増えつつあり、オファーサイドが減少したことで、ややレートにばらつきが出てきている。一巡後は▲0.015～0%近辺での出合いを中心に推移した。ターム物では、ロール案件の取引が散見された。

<レポ市場>

4/11のGC T/N(4/12-4/13)は、▲0.08～▲0.06%程度の出合い。S/N(4/13-4/14)は、▲0.075～▲0.065%程度の出合い。S/Nでは目立った要因がなかったことから、レートは横ばい圏内で取引されている。SCは新規・ロールオーバーともに幅広い銘柄で取引が見られた。個別銘柄では、30Y49・30Y50にビッドの出入りが多く見られ、オファーの出難さから、O/N中心に締まったレベルでの取引となっている。

<短国市場>

現先レートS/Nは低位横ばい圏での推移となった。アウトライト市場は材料に乏しく、閑散とした地合の中、3Mで▲0.478～▲0.477%、1Yで▲0.195%の取引が見られた程度であった。

<CP市場>

発行市場は、償還額が100億円程と極めて少なかったこともあり、発行総額が200億円強にとどまる閑散としたマーケットであった。4月中旬に入ったものの、依然として発行量は伸び悩む地合が継続している。発行レートに関しても、特段の変化は見られず、横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2016/4/11	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	▲ 0.006			0.001	－	▲ 0.087
T/N	▲ 0.015	0.000	▲ 0.012				－	▲ 0.065
S/N							－	－
1W	▲ 0.015	0.000	▲ 0.012				－	▲ 0.105
2W							－	▲ 0.111
3W							－	▲ 0.120
1M							－	▲ 0.134
3M							▲ 0.477	▲ 0.154
6M							▲ 0.251	▲ 0.170
1Y							▲ 0.192	▲ 0.185

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）
▲ 0.090	▲ 0.005	15,751.13	▲ 70.39	108.28-31	108.05-07

日付	4/4	4/5	4/6	4/7	4/8
日銀当預残	2,755,200	2,761,000	2,778,900	2,756,100	2,773,900
準備預金残	2,486,900	2,492,400	2,505,900	2,487,400	2,498,900
マネタリーベース	3,756,700	3,761,400	3,778,400	3,755,300	3,772,900
無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.007%	▲0.007%	▲0.007%	▲0.012%
コール市場残高	39,681	40,861	39,996	40,749	44,292
うち無担	28,965	30,548	29,357	30,533	34,229
うち有担	10,716	10,313	10,639	10,216	10,063

●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	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）
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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	32,496	2016/4/11	2016/4/12		633	633		▲0.500	▲0.503	

●2016年4月12日の予定

*3月の米財政収支
*3月の英消費者物価指数
*10年物価連動国債
（4,000億円、4/14発行）
*エネルギー対策借入
（6,000億円、4/20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