Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

	貝 並 市 和								
	ж. т. ф. п.	2016年4	4月13日	2016年4	4月14日	2016年4月15日			
	単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想			
	銀行券		400		▲ 800	4	1,000		
	財政		4 00		1, 700		70, 000		
	資金過不足		0		900	69, 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					12, 400			
	CP等買入		▲ 300		▲ 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			200					
	国債補完供給	▲ 1,000	1, 000		1, 000				
L	当預増減		▲ 300		1, 800		81, 400		
当	座預金残高	2,	770, 800	2,	772, 600	2, 854, 000			
	準 <u>備預金残高</u>	2,	496, 500						
	積み終了先	2,	053, 400		4月14日以	降の残り	听要積立額		
	超過準備		053, 400		積数		100		
L	非準備預金先		274, 300		1日平均		0		
積	み期間(3/16~	4/15) σ.)所要準	備額		2,	072, 100		

●2016年4月13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277兆2,000億円)。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%近辺での出合い。一巡後はやや取り上がりとなり、▲0.01~0.001%のレンジで推移した。ターム物は、出し取り共に動意が少なく、閑散であった。

〈レポ市場〉

4/13のGC T/N(4/14-4/15)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N (4/15-4/18)は、▲0.11~▲0.09%程度の出合い。S/Nは売り手の資金調達意欲が弱く、レートは低下した。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、30Y50のオファーが引き続き出難く、引け後もビッド残りとなっていた。その他では、5Y127にビッドの出入りが多く見られた。

〈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、前日に引き続き閑散とした地合いであった。引け際に3Mで▲0.474~▲0.472%、6Mで▲0.242%、1Yで▲0.199%の出合いが見られた。

〈CP市場〉

93.55%

CP発行市場は、償還総額2,100億円に対して、発行総額が3,200億弱の発行超となった。二営業日後が、5・10日発行にあたることから、石油・ノンバンク業態等からの大型発行案件が実施された。発行レートに関しては、目立った動きは見られず、横ばい圏での推移となった。

JGB新発10年債

●短期金融市場関連指標

実績

準備預金進捗率

2016/4/13		無担 (連報)			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	売買参考統計值	平均値
O/N	▲ 0.040	0.001	▲ 0.010			0.001	-	▲ 0.084
T/N	▲ 0.015	0.000	▲ 0.002				_	▲ 0.089
S/N			▲ 0.015				-	-
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.018				_	▲ 0.108
2W			0.030				_	▲ 0.113
3W							-	▲ 0.128
1M	▲ 0.020	0.225	▲ 0.008				_	▲ 0.143
3M							▲ 0.472	▲ 0.157
6M							▲ 0.242	▲ 0.179
1Y							▲ 0.194	▲ 0.188
A 7 II A								

日数

100.00%

直近値 前日		日比	15	時時点 7		前日比		為替(9時)	為替(17時)				
A	0.090 0.0		009	16	,381.22		452.43		108.69-71	108.92-94			
日付			4/	6	6 4/7		4/8		4/11	4/12			
日銀当預残			2,778	,900	2,756,100		2,773,900		2,746,000	2,771,100			
準備預金残			2,505,900		2,487,400		2,498,900		2,479,200	2,498,100			
マネタリーベース			3,778,400		3,755,300		3,772,900		3,743,500	3,767,800			
無担の	無担O/N加重平均			▲0.007%		▲0.007%		▲0.012%		▲0.005%			
コール市場残高		39,996		40,749		44,292		45,585	46,776				
	うち無担うち有担		29	,357	30,5	33	34,22	26	34,895	36,644			
			10	,639	10,2	16	10,06	33	10,690	10,132			

日経平均株価

ドル/円

●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

0.0 1851										
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	2016/4/15			14,329	3,508	0.002		0.003	90.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/4/15			18,298	4,405	0.007		0.009	79.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2016/4/15			17,037	4,508	0.006		0.007	99.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	36,466	2016/4/13	2016/4/14		888	888		▲0.500	▲0.518	

●2016年4月14日の予定

- *2月のマネタリーサーベィ
- *英中銀MPC結果発表
- *3月の米消費者物価指数
- *3月のユーロ圏消費者物価指数改定値
- *国庫短期証券(601回)入札
- (3ヶ月、44,000億円、4/18発行)
- *30年利付国債入札
 - (8,000億円、4/18発行)

*交付税特別会計借入 (10,500億円、4/22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。

ガスに盛っての成りする音曲で日間元音でようかがへにとい。 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