Central Daily Market Report

2016年4月14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14日 需給速報		2016年4月15日 需給予想		2016年4月18日 当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 800		0	
財政	▲ 400		70,500		▲ 6,000	
資金過不足	▲ 1,200		69,700		▲ 6,000	
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					3,200	▲ 3,300
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,700			
CP等買入		▲ 300		▲ 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	200		300			
国債補完供給	▲ 600	1,000		600		
当預増減	▲ 900		82,800		▲ 6,100	

当座預金残高	2,769,900	2,852,700	2,846,600
準備預金残高	2,495,600		
積み終了先	2,049,300		
超過準備	2,049,200		
非準備預金先	274,300		

4月15日以降の残り所要積立額	
積数	0
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 96.77%

●2016年4月14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6,000億円減少の205兆3,000億円(当座預金残高見込みは277兆3,000億円)。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%での出合い。積み最終日を控えてマイナスレートでの運用先がやや減少しているため、一巡後はやや取り上がり▲0.01～0.001%のレンジでの出合いで推移した。ターム物では、ロール案件の取引が散見された。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3,210億円（期落ち額3,290億円）の札割れとなった。

<レポ市場>

4/14のGC T/N(4/15-4/18)は、▲0.09～▲0.085%程度の出合い。S/N(4/18-4/19)は、▲0.085～▲0.07%程度の出合い。S/Nは短国発行日で売り手の資金調達意欲が強く、レートは上昇した。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、連日締まったレベルで推移していた30Y50が、4/14の30年債入札でリオープン発行となったことから、ビッドはほとんど見られなかった。

<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。本日は3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.180～▲0.170%といった堅調な水準で取引が見られる中、平均落札利回▲0.1689%、按分落札利回▲0.1447%と若干流れ気味の結果となった。セカンダリー市場では、引け際に3M▲0.185～▲0.165%、6M▲0.241～▲0.210%、1Y▲0.214～▲0.205%で散発的に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、600億円弱の償還総額に対して、発行総額は700億円台半ばとなった。商社業態等から大型発行案件が実施されたものの、市場の規模はあまり膨らまなかった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2016/4/14	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	▲ 0.030	0.001	▲ 0.005			0.001	－	▲ 0.082
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.088
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.020				－	▲ 0.108
2W							－	▲ 0.116
3W							－	▲ 0.128
1M	0.120	0.130	0.125				－	▲ 0.143
3M							▲ 0.185	▲ 0.159
6M							▲ 0.232	▲ 0.179
1Y							▲ 0.202	▲ 0.188

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)
▲ 0.095	▲ 0.005	16,911.05	529.83	109.43-44	109.31-32

日付	4/7	4/8	4/11	4/12	4/13
日銀当預残	2,756,100	2,773,900	2,746,000	2,771,100	2,770,800
準備預金残	2,487,400	2,498,900	2,479,200	2,498,100	2,496,500
マネタリーベース	3,755,300	3,772,900	3,743,500	3,767,800	3,767,200
無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.012%	▲0.006%	▲0.005%	▲0.010%
コール市場残高	40,749	44,292	45,585	46,776	45,457
うち無担	30,533	34,229	34,895	36,644	35,015
うち有担	10,216	10,063	10,690	10,132	10,442

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	601	－	43,600	2016/4/18	2016/7/19	209,852.0	39,712.8	100.0365	▲0.1447%	76.1837%	100.0426	▲0.1689%	3,887.0
30年利付国債	50	0.80%	8,000	2016/4/18	2046/3/20	24,744.0	7,300.0	110.3500	0.4110%	33.3333%	111.0200	0.3880%	698.0
交付税特会	－	－	10,500	2016/4/22	2016/10/21	97,319.0	10,500.3		0.0010%	10.7894%		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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	30,709	2016/4/14	2016/4/15		525	525		▲0.500	▲0.500	
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2016/4/18	2016/5/2		3,210	3,210		0.000	0.000	

●2016年4月15日の予定

*2月の特定サービス産業動態統計速報
*2月の石油等消費動態統計
*3月の米鉱工業生産・設備稼働率
*4月のミシガン大消費者信頼感指数速報

◆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