# Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●其並需和											
	*	2016年4	4月12日	2016年4	4月13日	2016年4月14日					
	単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想					
	銀行券		800		400		0				
	財政		1, 700		▲ 500	4	2,000				
	資金過不足		2, 500		▲ 100	<b>▲</b> 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										
	国債買現										
	国庫短期証買入	17, 500									
	国債買入	5, 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	300									
	国債補完供給	<b>▲</b> 1,000	700		1, 000						
	当預増減		25, 100		600	4	2,000				
当	座預金残高	2,	771, 100	2,	771, 700	2, 769, 700					
	準備預金残高	2,	498, 100								
	積み終了先	2, (	053, 900		4月13日以	降の残り	<b>听要積立額</b>				
	超過準備		053, 900		積数		100				
	非準備預金先		273, 000		1日平均	0					
積	み期間(3/16~	4/15) <i>o</i> .	)所要準	備額		2, 072, 100					
Ē											

## ●2016年4月12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1兆5,000億円増加の205兆 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、国内勢のテイクンで始まった。一巡後は積み最 終日を控えた取り調整の動きから、0%の出合いも散見されつつ、本日の取 引を終えた。ターム物はロール案件中心の出合いであった。

# 〈レポ市場〉

4/12のGC T/N(4/13-4/14)は、▲0.09~▲0.07%程度の出合い。S/N (4/14-4/15)は、▲0.09~▲0.07%程度の出合い。T/N·S/Nとも目立った要 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に引き続き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、前日 に引き続き目立った材料に乏しく、閑散とした地合が継続しており、3Mで▲ 0.470%、6Mで▲0.247%、1Yで▲0.190%の取引が散発的に行われた程度 であった。

### 〈CP市場〉

90.32%

CP発行市場は、償還総額700億円弱に対して、発行総額が300億円台半ば 程度と、償還超のマーケットであった。発行レートは、概ね0%近辺となってい

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

2016/4/12	無担(速報)				有担(連報)	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	▲ 0.030	0.001	▲ 0.005			0.001	-	▲ 0.083
T/N			▲ 0.015				ı	▲ 0.076
S/N							-	-
1W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.022				-	▲ 0.108
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.112
3W							-	▲ 0.125
1M							-	▲ 0.139
3M							▲ 0.474	▲ 0.154
6M							▲ 0.242	▲ 0.172
1Y							▲ 0.193	▲ 0.186

日数

100.00%

直泊	直近値 前日		日比	15	時時点	前日比		I	為替(9時)	為替(17時)			
<b>A</b> 0	▲ 0.099		0.009	15,928.79		177.66			107.96-97	108.19-22			
	日付		4/!	5 4/6			4/7		4/8	4/11			
日銀当預残			2,761,	2,761,000		2,778,900		2,756,100		2,746,000			
準備預	準備預金残			2,492,400		2,505,900		2,487,400		2,479,200			
マネタ	マネタリーベース			3,761,400		3,778,400		3,755,300		3,743,500			
無担O	無担O/N加重平均			▲0.007%		▲0.007%		▲0.007%		▲0.006%			
コール	コール市場残高			40,861		39,996		40,749		45,585			
	うち無担		30,	548	29,3	57	30,533		34,229	34,895			
うち有担		10,	313	10,6	39	10,21	16	10,063	10,690				

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)	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)
10年物価連動債	21	0.10%	4,000	2016/4/14	2026/3/10	11,350.0	4,000.0	104.9000	▲0.3760%	80.0000%			
エネルギー対策	_	-	6,000	2016/4/20	2017/4/20	34,900.0	6,000.0		0.0010%	17.1920%		0.0010%	

# ●オペ結果

稚類	オファー額(億円)	スタート日	エンド日	貸付利率	応礼総額 (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)	22,261	2016/4/12	2016/4/13		915	915		▲0.500	▲0.519	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	474	2016/4/12	2016/4/13		1	1		▲0.500	▲0.500	
米ドル資金供給		2016/4/14	2016/4/21	0.86	0	0				

# ●2016年4月13日の予定

\*3月の企業物価指数

\*山口県金融経済懇談会にて原田審議委員講演

\*米ベージュブック \*3月のマネーストック

\*2月の米企業在庫

\*3月の米生産者物価指数

\*3月の米小売売上高

\*TB2M(発行中止)

- ◆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