Central Daily Market Report

2016年4月18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18日 需給速報		2016年4月19日 需給予想		2016年4月20日 当社予想	
銀行券	600		▲ 1,000		▲ 2,000	
財政	▲ 9,600		4,800		▲ 13,000	
資金過不足	▲ 9,000		3,800		▲ 15,000	
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			10,000			
国債買入			12,800		5,500	
CP等買入		▲ 100		▲ 200	3,000	
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
ＥＴＦ買入	100		300			
国債補完供給		600				
当預増減	▲ 8,500		26,500		▲ 6,500	

当座預金残高	2,843,400	2,869,900	2,863,400
準備預金残高	2,556,800		
積み終了先	2,039,700		
超過準備	2,000,700		
非準備預金先	286,600		

4月19日以降の残り所要積立額	
積数	94,100
1日平均	3,500

積み期間（4/16～5/15）の所要準備額	2,037,700

準備預金進捗率	実績	95.38%	日数	10.00%

●2016年4月18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3,000億円減少の210兆7,000億円(当座預金残高見込みは284兆4,000億円)。朝方の無担O/N物は投信業態の▲0.08%のオファーで始まった。オファーサイドのレートが大きく低下したものの、ビッドサイドが慎重な動きとなっており、出合いは然程膨らまなかった。一巡後は▲0.08%以下の運用希望も一部に見られつつ、本日の取引を終えた。ターム物は1W～1M程度で▲0.06～▲0.05%の出合いが散見された。

<レポ市場>

4/18のGC T/N(4/19-4/20)は、▲0.10～▲0.09%程度の出合い。S/N(4/20-4/21)は、▲0.11～▲0.095%程度の出合い。S/Nは国債買入オペ等の要因で、レートが一段と低下した。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10y336～341、5y126～5y127、30y49などにビッドが多く見られた。

<短国市場>

現先S/N物は引続き低位で推移した。短国市場は、3Mで▲0.19%、6Mで▲0.224%の出合いが見られたものの、全体として閑散な地合だった。本日は1Y物の入札が実施された。入札結果は、WI取引において▲0.20%の出合いが見られていたこともあり、平均落札利回▲0.2155%、按分落札利回▲0.2045%と強い結果となった。セカンダリーでは▲0.265%で少額の出合いが見られた。

<CP市場>

五・十日発行に当たり、鉄鋼、電気機器、卸売業態等、複数の業態でまとまった額が発行された。償還総額670億円に対し、発行総額は4,200億円程度まで膨らんだ。発行は膨らんだものの、投資家・ディーラー共に買いニーズが強く、発行レートは引続き0%近辺で推移していた。

●短期金融市場関連指標

2016/4/18	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	▲ 0.086	0.010	▲ 0.074				－	▲ 0.084
T/N	▲ 0.080	▲ 0.050	▲ 0.075				－	▲ 0.093
S/N							－	－
1W	▲ 0.070	0.000	▲ 0.055				－	▲ 0.110
2W			▲ 0.055				－	▲ 0.118
3W			▲ 0.065				－	▲ 0.128
1M			▲ 0.060				－	▲ 0.146
3M							▲ 0.187	▲ 0.161
6M							▲ 0.225	▲ 0.180
1Y							▲ 0.247	▲ 0.190

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）
▲ 0.120	▲ 0.005	16,275.95	▲ 572.08	108.07-08	108.21-23

日付		4/11	4/12	4/13	4/14	4/15
日銀当預残		2,746,000	2,771,100	2,770,800	2,769,900	2,851,900
準備預金残		2,479,200	2,498,100	2,496,500	2,495,600	2,571,000
マネタリーベース		3,743,500	3,767,800	3,767,200	3,767,000	3,849,800
無担O/N加重平均		▲0.006%	▲0.005%	▲0.010%	▲0.005%	▲0.010%
コール市場残高		45,585	46,776	45,457	45,370	30,905
	うち無担	34,895	36,644	35,015	35,305	23,842
	うち有担	10,690	10,132	10,442	10,065	7,063

●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）	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	602	－	25,000	2016/4/20	2017/4/20	129,812.0	22,821.9	100.2050	**▲0.2045%**	**47.1631%**	100.2160	**▲0.2155%**	2,178.0

●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
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,500	2016/4/20			12,325	4,505	▲0.017		▲0.013	72.5
国債買入（変動利付債）	1,000	2016/4/20			4,199	1,004	0.250		0.057	26.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	20,000	2016/4/18	2016/4/19		9	9		▲0.500	▲0.500	

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）
被災地金融支援オペ	第60回	2016/4/22	2017/4/21	0	1,068

●2016年4月19日の予定

*5年利付国債入札
（24,000億円、4/21発行）

*3月の米住宅着工件数

◆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