

Central Daily Market Report

2016年4月20日(水)

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20日		2016年4月21日		2016年4月22日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 2,200		▲ 2,000	
財政	▲ 25,800		▲ 23,900		▲ 11,000	
資金過不足	▲ 27,200		▲ 26,100		▲ 13,000	
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	5,800				12,400	
CP等買入	3,000	▲ 500		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						1,100
社債等買入						
E T F買入			300			
国債補完供給	▲ 700			700		
当預増減	▲ 19,600		▲ 25,200		500	
当座預金残高	2,849,800		2,824,600		2,825,100	
準備預金残高	2,549,500					
積み終了先	2,079,300		4月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,072,000		積数	37,700		
非準備預金先	300,300		1日平均	1,500		
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	98.15%	日数	16.67%		

●2016年4月20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2兆5,000億円減少の209兆8,000億円(当座預金残高見込みは285兆1,000億円)。朝方の無担O/N物は投信業態の▲0.086~▲0.08%の出合いで始まった。一巡後は▲0.08%程度の出合いが散発的に見られ本日の取引を終えた。ターム物は案件無く閑散であった。

<レポ市場>

4/20のGC T/N(4/21-4/22)は、▲0.10~▲0.085%程度の出合い。S/N(4/22-/25)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/Nは引き続き資金調達ニーズが薄く、動意無く閑散とした引合いに終始した。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、5y125~5y126、30y49、40y8などにビッドが多く見られた。

<短国市場>

現先S/N物は低水準で推移した。短国市場は閑散状態が続いており、引け際に3Mで▲0.190%、6Mで▲0.245~▲0.225%、1Yで▲0.273%の出合いが散見された程度であった。

<CP市場>

CP市場は、ノンバンクや機械業態でまとまった額の調達が行われ、償還総額1,200億円に対し、発行総額1,500億円弱まで膨らんだ。引続き発行レートに変化は見られず、期間の長短に関わらず、大部分の銘柄が0%近辺で決着している。

●短期金融市場関連指標

2016/4/20	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.086	0.000	▲ 0.080				-	▲ 0.093	▲ 0.135	▲ 0.005	16,906.54	32.10	109.21-23	108.90-92
T/N	▲ 0.080	0.000	▲ 0.065				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.060	▲ 0.063				-	▲ 0.124						
2W			0.010				-	▲ 0.135						
3W							-	▲ 0.142						
1M			▲ 0.075				-	▲ 0.156						
3M							▲ 0.189	▲ 0.170						
6M							▲ 0.234	▲ 0.185						
1Y							▲ 0.271	▲ 0.194						
									日付	4/13	4/14	4/15	4/18	4/19
									日銀当預残	2,770,800	2,769,900	2,851,900	2,843,400	2,869,400
									準備預金残	2,496,500	2,495,600	2,571,000	2,556,800	2,574,500
									マネタリーベース	3,767,200	3,767,000	3,849,800	3,840,700	3,867,800
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.005%	▲0.010%	▲0.074%	▲0.078%
									コール市場残高	45,457	45,370	30,905	39,243	39,702
									うち無担	35,015	35,305	23,842	26,554	28,507
									うち有担	10,442	10,065	7,063	12,689	11,195

●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1非価格競争入札(億円)
交付税特会	-	-	10,500	2016/4/28	2016/10/28	92,821.0	10,500.04		0.0010%	11.3122%		0.0010%	

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	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	2016/4/22			12,942	3,509	▲0.003		▲0.001	3.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/4/22			18,418	4,407	▲0.001		0.000	91.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2016/4/22			14,079	4,503	▲0.003		▲0.001	12.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	31,532	2016/4/20	2016/4/21		46	46		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	80,000	2016/4/20	2016/4/21		619	619		▲0.600	▲0.600	
社債等買入	1,000	2016/4/26			2,029	1,000	▲0.214		▲0.138	46.2

●2016年4月21日の予定

*ECB定例理事会(金融政策発表)

*国庫短期証券(603回)入札
(3ヶ月、44,000億円、4/25発行)
*20年利付国債入札
(11,000億円、4/25発行)

◆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録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