Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●貧筮斋稻							
* /	2016年	4月22日	2016年4	4月25日	2016年4月26日		
単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想		
銀行券	4	2, 700	A	1,000	▲ 2,000		
財政	4	9,600		▲ 600	1 ,000		
資金過不足	A	12, 300	4	1,600	▲ 3,000		
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, 700			
国債買現							
国庫短期証買入					15, 000		
国債買入	12, 600				11, 900		
CP等買入		▲ 500		▲ 500			
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		▲ 300		▲ 300	1, 000		
ETF買入							
国債補完供給	▲ 400	100		400			
当預増減		300		2, 500		24, 900	
当座預金残高	2,	823, 300	2, 8	820, 800	2, 845, 700		
準備預金残高	2,	533, 900					
積み終了先	2,	071, 200		4月25日以	降の残り所要積立額		
超過準備	2,	068, 500		積数	9, 400		
非準備預金先		289, 400		1日平均	400		
積み期間(4/16~	5/15) σ.)所要準	備額		2, 037, 700		
準備預金進捗率	実績		99.54%	日数	30.00%		

●2016年4月22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2,000億円増加の207兆2,000億円(当 座預金残高見込みは282兆4,000億円)。朝方の無担O/N物は投信業態の▲0.08%オ ファーに対し、▲0.086%ビッドで始まった。立ち上がりはギブンで寄り付き▲0.086%の 出合い。一巡後は▲0.08~▲0.06%の出合いが散発的に見られつつ本日の取引を終 えた。ターム物は案件無く閑散であった。

〈レポ市場〉

4/22のGC T/N(4/25-4/26)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。S/N(4/26-4/27) は、▲0.115~▲0.10%程度の出合い。S/Nは短国·国債買入オペがオファーされたこ とで資金調達ニーズが薄くなり、レートを一段と下げての出合いとなった。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、5y 125~5y126、30y49~30y50、40y7~40y8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。短国買入オペは前回比で5,000億円増額の1兆 5,000億円でオファーされた。平均落札利回較差▲0.062%、按分落札利回較差▲ 0.250%とテールが伸び、強い結果となった。応募限度額が買入額の4分の1のままで あったことや、新発3M物が買入対象外となったことが影響したと見られる。セカンダ リー市場では、1Y物▲0.303~▲0.293%の調整的な出合いが見られた程度であった。

〈CP市場〉

償還総額250億円程度に対して、発行総額は650億円強の発行超となった。大型案件 は無いものの、案件数が多く、若干の発行超となった。発行レートは特段の動きも見ら れず、0%近辺での推移となっていた。

JGB新発10年債

●短期金融市場関連指標

2016/4/22	無担(速報)				有担 (速報)	短国	果. 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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.080				-	▲ 0.092
T/N	▲ 0.086	▲ 0.010	▲ 0.081				-	▲ 0.093
S/N							-	-
1W	▲ 0.066	▲ 0.065	▲ 0.065				-	▲ 0.135
2W							-	▲ 0.148
3W	▲ 0.070	0.000	▲ 0.047				-	▲ 0.157
1M			0.080				-	▲ 0.175
3M							▲ 0.302	▲ 0.191
6M							▲ 0.306	▲ 0.200
1Y							▲ 0.298	▲ 0.208

直泊	丘値	前日	3比	15	15時時点		前日比		為替(9時)	為替(17時)	
A 0).125	0.0	000 17,		,572.49		208.87		109.46-48	110.57-60	
	日付		4/1	5	4/18		4/19		4/20	4/21	
日銀当	日銀当預残		2,851,900		2,843,400		2,869,400		2,849,800	2,823,000	
準備預	準備預金残		2,571,000		2,556,800		2,574,500		2,549,500	2,527,500	
マネタリーベース		ース	3,849,800		3,840,700		3,867,800		3,849,600	3,825,100	
無担O/N加重平均		▲0.010%		▲0.074%		▲0.078%		▲0.080%	▲0.081%		
コール	コール市場残高		30,905		39,243		39,702		40,286	43,126	
	ゔ゙゙゙゙゙゙	ち無担	23,842		26,5	54	28,507		29,038	29,084	
	ゔ゙゙゙゙゙゙	ち有担	7	,063	12,6	89	11,19		11,248	14,042	

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 競争入礼(億円)
交付税特会	_	-	10,500	2016/5/6	2016/11/2	70,733.0	10,500.05		0.0010%	14.8868%		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
国庫短期証券買入	15,000	2016/4/26			17,627	15,000	▲0.250		▲0.062	78.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2016/4/26			14,082	3,504	0.008		0.010	0.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/4/26			16,379	4,406	0.008		0.010	8.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,200	2016/4/26			7,286	2,208	0.003		0.007	98.6
国債買入(残存期間25年超)	1,800	2016/4/26			5,750	1,802	▲0.019		▲0.007	21.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	21,767	2016/4/22	2016/4/25		249	249		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	20,000	2016/4/22	2016/4/25		71	71		▲0.600	▲0.600	

●2016年4月25日の予定

- *3月の企業向けサービス価格指数
- *2月の景気動向指数改訂状況
- *3月の米新築一戸建て販売件数
- *流動性供給入札
- (5,000億円、4/27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