

# Central Daily Market Report

2016年4月26日(火)  
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26日		2016年4月27日		2016年4月28日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	▲ 3,300	▲ 4,000	▲ 3,600			
財政	6,500	▲ 7,400	▲ 8,600			
資金過不足	3,200	▲ 11,400	▲ 12,200			
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					100	▲ 6,200
国債買現						
国庫短期証買入	15,000					
国債買入	12,900				8,500	
CP等買入		▲ 200		▲ 200	4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,000					
E T F買入			600			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当増減	32,000	▲ 10,900	▲ 5,800			
当座預金残高	2,852,900	2,842,000	2,836,200			
準備預金残高	2,561,100					
積み終了先	2,100,600		4月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,100,600		積数	6,200		
非準備預金先	291,800		1日平均	300		
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	99.70%	日数	36.67%		

## ●2016年4月26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3兆円増加の210兆3,000億円(当座預金残高見込みは285兆5,000億円)。朝方の無担O/N物は▲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▲0.086~▲0.075%の出合い。一巡後は▲0.06%まで取り上がる動きも見られた。午後にかけては閑散となり、本日の取引を終えた。ターム物はロール案件中心で閑散であった。本日の共通担保資金供給オペは、3M物が1兆5,000億円でオファーされ、応札額80億円(期落ち分6,193億円)の札割れとなった。

### <レポ市場>

4/26のGC T/N(4/27-4/28)は、▲0.10~▲0.095%程度の出合い。S/N(4/28-5/2)は、▲0.14~▲0.12%程度の出合い。S/Nは月末初の取引となり、投資家の資金調達意欲が弱く、玉確保の買いが入り、▲0.10%を下回る水準での引合いが中心となった。SCは個別銘柄では10y336~342、30y49~30y50、40y8などにビッドが多く見られた。

### <短国市場>

現先レートT/Nは低水準で推移した。アウトライト市場は特段材料無く、1Y物で▲0.275%の出合いが見られた程度と閑散であった。

### <CP市場>

発行市場は償還総額8,700億円程度に対し、月末発行にあたり石油・ノンバンク・商社・機械等の幅広い業態で大型発行案件が見られ、発行総額は8,900億円程度と活況なマーケットとなった。発行レートは引き続き0%近辺での足切りが多く見られた。

## ●短期金融市場関連指標

2016/4/26	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.086	▲ 0.010	▲ 0.067				-	▲ 0.092	▲ 0.105	▲ 0.030		17,353.28	▲ 86.02	111.12-14	110.84-86
T/N			▲ 0.070				-	▲ 0.093							
S/N			▲ 0.065				-	-							
1W							-	▲ 0.146							
2W	▲ 0.065	0.230	▲ 0.051				-	▲ 0.154							
3W							-	▲ 0.164							
1M	▲ 0.060	0.010	▲ 0.033				-	▲ 0.179							
3M							▲ 0.310	▲ 0.196							
6M							▲ 0.306	▲ 0.207							
1Y							▲ 0.298	▲ 0.214							
									日付	4/19	4/20	4/21	4/22	4/25	
									日銀当預残	2,869,400	2,849,800	2,823,000	2,823,300	2,820,900	
									準備預金残	2,574,500	2,549,500	2,527,500	2,533,900	2,538,900	
									マネタリーベース	3,867,800	3,849,600	3,825,100	3,828,100	3,827,000	
									無担O/N加重平均	▲0.078%	▲0.080%	▲0.081%	▲0.080%	▲0.075%	
									コール市場残高	39,702	40,286	43,126	50,327	57,219	
									うち無担	28,507	29,038	29,084	37,906	43,545	
									うち有担	11,195	11,248	14,042	12,421	13,674	

## ●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)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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
米ドル資金供給		2016/4/28	2016/5/12	0.85	0	0				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2016/4/28			8,983	4,501	▲0.013		▲0.008	100.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,200	2016/4/28			6,324	2,203	▲0.018		▲0.012	20.4
国債買入(残存期間25年超)	1,800	2016/4/28			5,595	1,803	▲0.050		▲0.037	9.7
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	15,000	2016/4/28	2016/8/9		80	80				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2016/4/26	2016/4/27		51	51		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/4/26	2016/4/27		78	78		▲0.600	▲0.600	

## ●2016年4月27日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合(1日目)	*国庫短期証券(604回)入札(3ヶ月、44,000億円、5/2発行)	*交付税特別会計借入(10,500億円、5/12借入)
*米FOMC(2日目)	*2年利付国債入札(23,000億円、5/16発行)	
*1-3月期の英GDP速報値		

◆本資料は信頼できるとさ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