Central Daily Market Report

2016年4月28日（木）
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28日 需給速報		2016年5月2日 需給予想		2016年5月6日 当社予想	
銀行券	▲ 4,300		▲ 100		3,000	
財政	4,900		▲ 22,600		▲ 7,000	
資金過不足	600		▲ 22,700		▲ 4,000	
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	100	▲ 6,200	1,800	▲ 9,700		
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,300					
CP等買入	4,000	▲ 2,400		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300				
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 300	100		300		
当預増減	4,900		▲ 30,800		▲ 4,000	

当座預金残高	2,844,100	2,813,300	2,809,300
準備預金残高	2,545,700		
積み終了先	2,091,600		
超過準備	2,091,300		
非準備預金先	298,400		

5月2日以降の残り所要積立額	
積数	2,400
1日平均	200

積み期間（4/16～5/15）の所要準備額			2,046,800
準備預金進捗率	実績	99.88%	日数 53.33%

●2016年4月28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1兆3,000億円増加の210兆2,000億円(当座預金残高見込みは284兆7,000億円)。朝方の無担O/N物は上昇基調で推移し、▲0.06%オファーに対し▲0.07%ビッドで始まった。立ち上がりは▲0.07～▲0.055%の出合いで、一部では▲0.04%の出合いも見られた。午後にかけては資金調達ニーズが弱くなり、本日の取引を終えた。ターム物は出合いが見られなかった。金融政策決定会合では、金融政策の現状維持が賛成多数で決定された。

<レポ市場>

4/28のGC T/N(5/2-5/6)は、▲0.10～▲0.08%程度の出合い。S/N(5/6-5/9)は、▲0.095～▲0.085%程度の出合い。T/N、S/Nともに投資家の資金調達意欲はしっかりで、レートはやや上昇傾向で推移した。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、決定会合と週末が重なったため短国買入オペが無く、後場に3M物で▲0.29～▲0.26%、1Y物で▲0.296%の出合いが見られた程度となった。

<CP市場>

発行市場は償還総額1,600億円程度に対し、商社・石油・鉄鋼業態から大型発行案件が見られ、発行総額は2,400億円程度と発行超となった。発行レートは概ね0%と、横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/4/28	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	▲ 0.078	0.000	▲ 0.056				－	▲ 0.087
T/N							－	▲ 0.089
S/N							－	－
1W	▲ 0.070	▲ 0.050	▲ 0.065				－	▲ 0.149
2W			0.010				－	▲ 0.154
3W							－	▲ 0.164
1M	▲ 0.020	0.000	▲ 0.015				－	▲ 0.179
3M							▲ 0.285	▲ 0.198
6M							▲ 0.306	▲ 0.210
1Y							▲ 0.296	▲ 0.217

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)
▲ 0.085	▲ 0.015	16,666.05	▲ 624.44	111.51-53	108.39-41

日付		4/21	4/22	4/25	4/26	4/27
日銀当預残		2,823,000	2,823,300	2,820,900	2,852,900	2,839,200
準備預金残		2,527,500	2,533,900	2,538,900	2,561,100	2,539,800
マネタリーベース		3,825,100	3,828,100	3,827,000	3,862,300	3,852,700
無担O/N加重平均		▲0.081%	▲0.080%	▲0.075%	▲0.067%	▲0.058%
コール市場残高		43,126	50,327	57,219	56,115	53,292
	うち無担	29,084	37,906	43,545	43,417	41,779
	うち有担	14,042	12,421	13,674	12,698	11,513

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ⅰ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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	54,245	2016/4/28	2016/5/2		272	272		▲0.600	▲0.600	

●2016年5月2日の予定

*米国3月の建設支出　*米国4月のISM製造業景況指数　*英国祝日（May Day）

●日銀金融政策決定会合・結果

●現行の金融政策方針の維持を賛成多数で決定。
●また、日本銀行は、熊本地震の被災地の金融機関を対象に、復旧・復興に向けた資金需要への対応を支援するため、被災地金融機関支援オペ（貸付総額3,000億円、無利息で実施、残高の2倍の金額をゼロ%の金利を適用する「マクロ加算残高」に加算）等の措置を導入することを決定した（全員一致）。

◆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