

Central Daily Market Report

2016年4月15日(金)

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15日		2016年4月18日		2016年4月19日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 700		800		▲ 1,000	
財政	70,200		▲ 9,100		2,000	
資金過不足	69,500		▲ 8,300		1,000	
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	12,700				11,900	
CP等買入		▲ 500		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
E T F買入	300		100			
国債補完供給	▲ 600	600		600		
当預増減	82,000		▲ 7,800		22,900	
当座預金残高	2,851,900		2,844,100		2,867,000	
準備預金残高	2,571,000					
積み終了先	2,110,600		4月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,110,600		積数	190,300		
非準備預金先	280,900		1日平均	6,800		
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	90.66%	日数	6.67%		

●2016年4月15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5兆7,000億円増加の211兆円(当座預金残高見込みは285兆3,000億円)。朝方の無担O/N物は、▲0.01%のオファーに対して、▲0.03%のビッドで始まった。立ち上がりは▲0.015~▲0.010%での出会い。積み最終日であることに加え、休日の関係で新しい積み期に掛かる取引になることから、調達サイドの参加者は限定的であった。一部の先からは積極的な運用ニーズが見受けられ、一巡後はややレートが低下し、▲0.02~0.001%のレンジでの出会いで推移した。ターム物では、ロール案件の取引が散見された。

<レポ市場>

4/15のGC T/N(4/18-4/19)は、▲0.08~▲0.07%程度のお合い。S/N(4/19-4/20)は、▲0.095~▲0.085%程度のお合い。S/Nは短国買入オベ等の要因で、レートが低下した。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、5Y127のオファーが出難く、O/N中心にレートは強含みとなっていた。

<短国市場>

本日は短国買入オベが前日比7,500億円減額の10,000億円でオファーされ、平均落札利回較差+0.029%、按分落札利回較差▲0.001%となり、前回と同様にテールが流れる結果となった。セカンダリー市場では引け際にカレント物で、1Y物▲0.205%、6M物▲0.228%、3M物▲0.185%の散発的な出会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1,000億円強の発行超となった。石油、小売業態からの大型案件も見られ、マーケットはやや膨らんだ。発行レートは特段の動きが見られず、横ばい圏での推移となった。CP等買入オベが、前日比500億円増額の3,000億円でオファーされ、平均落札利回▲0.011%、按分落札利回▲0.024%と、前回結果から小幅上昇となった。

●短期金融市場関連指標

2016/4/15	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	▲ 0.040	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.082	▲ 0.115	▲ 0.020	16,848.03	▲ 63.02	109.34-35	109.29-31
T/N	▲ 0.060	▲ 0.030	▲ 0.054				-	▲ 0.077						
S/N			▲ 0.060				-	-						
1W			▲ 0.050				-	▲ 0.108						
2W			0.200				-	▲ 0.116						
3W							-	▲ 0.128						
1M			▲ 0.050				-	▲ 0.143						
3M							▲ 0.185	▲ 0.160						
6M							▲ 0.228	▲ 0.179						
1Y							▲ 0.202	▲ 0.188						
									日付	4/8	4/11	4/12	4/13	4/14
									日銀当預残	2,773,900	2,746,000	2,771,100	2,770,800	2,769,900
									準備預金残	2,498,900	2,479,200	2,498,100	2,496,500	2,495,600
									マネタリーベース	3,772,900	3,743,500	3,767,800	3,767,200	3,767,000
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.006%	▲0.005%	▲0.010%	▲0.005%
									コール市場残高	44,292	45,585	46,776	45,457	45,370
									うち無担	34,229	34,895	36,644	35,015	35,305
									うち有担	10,063	10,690	10,132	10,442	10,065

●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非償還競争入札(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)	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
国庫短期証券買入	10,000	2016/4/19			19,679	10,001	▲0.001		0.029	92.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2016/4/19			14,400	3,504	0.003		0.004	68.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/4/19			15,504	4,407	▲0.004		▲0.002	61.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,200	2016/4/19			8,403	2,207	▲0.003		0.001	82.7
国債買入(残存期間25年超)	1,800	2016/4/19			5,582	1,802	▲0.018		▲0.006	57.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2016/4/15	2016/4/18		549	549		▲0.500	▲0.500	
CP等買入	3,000	2016/4/20			8,452	2,990	▲0.024		▲0.011	13.0

●2016年4月18日の予定

*国庫短期証券(602回)入札
(1年、25,000億円、4/20発行)

◆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各自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