

Central Daily Market Report

2016年4月19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19日		2016年4月20日		2016年4月21日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 1,300		▲ 3,000	
財政	4,400		▲ 25,100		▲ 20,000	
資金過不足	3,300		▲ 26,400		▲ 23,000	
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	10,000					
国債買入	12,800		5,800			
CP等買入		▲ 200	3,000	▲ 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		▲ 200				
E T F買入	300					
国債補完供給						
当預増減	26,000		▲ 18,100		▲ 23,000	
当座預金残高	2,869,400		2,851,300		2,828,300	
準備預金残高	2,574,500					
積み終了先	2,088,200		4月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,078,000		積数		56,500	
非準備預金先	294,900		1日平均		2,200	
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	97.23%	日数	13.33%		

●2016年4月19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1兆6,000億円増加の212兆3,000億円(当座預金残高見込みは287兆円)。朝方の無担O/N物は投信業態の▲0.08%のオファーに対し、▲0.086%のビッドで始まり、立ち上がりは▲0.086%の出合い。一部では▲0.07%の出合いも散見された。一巡後は閑散で▲0.086~▲0.08%の出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物はロール案件中心の出合いであった。

<レポ市場>

4/19のGC T/N(4/20-4/21)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。S/N(4/21-4/22)は、▲0.105~▲0.10%程度の出合い。S/Nは資金調達ニーズが薄く、動き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などにビッドが多く見られた。

<短国市場>

現先S/N物は低位横ばい圏で推移した。短国市場は閑散な地合いが継続しており、引け際に6Mで▲0.225%、1Yで▲0.265%の出合いが散発的に見られた程度であった。

<CP市場>

CP市場は、ノンバンクや卸売業態で一部まとまった額の発行がみられたものの、発行総額は800億円程度にとどまり、落ち着いた地合となった。発行レートに特段の変化は見られず、多くの銘柄が0%近辺で決着した。

●短期金融市場関連指標

2016/4/19	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	▲ 0.010	▲ 0.078				-	▲ 0.091	▲ 0.130	▲ 0.010	16,874.44	598.49	109.08-10	109.12-14
T/N	▲ 0.080	0.000	▲ 0.072				-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.037				-	▲ 0.117						
2W							-	▲ 0.132						
3W							-	▲ 0.140						
1M			▲ 0.070				-	▲ 0.155						
3M							▲ 0.187	▲ 0.166						
6M							▲ 0.225	▲ 0.183						
1Y							▲ 0.258	▲ 0.193						
									日付	4/12	4/13	4/14	4/15	4/18
									日銀当預残	2,771,100	2,770,800	2,769,900	2,851,900	2,843,400
									準備預金残	2,498,100	2,496,500	2,495,600	2,571,000	2,556,800
									マネタリーベース	3,767,800	3,767,200	3,767,000	3,849,800	3,840,700
									無担O/N加重平均	▲0.005%	▲0.010%	▲0.005%	▲0.010%	▲0.074%
									コール市場残高	46,776	45,457	45,370	30,905	39,243
									うち無担	36,644	35,015	35,305	23,842	26,554
									うち有担	10,132	10,442	10,065	7,063	12,689

●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	素分率	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)
5年利付国債	127	0.10%	24,000	2016/4/21	2021/3/20	95,217.0	21,850.0	101.6000	▲0.2220%	20.2939%	101.6200	▲0.2260%	2,138.0

●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	申込総額(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)	20,000	2016/4/19	2016/4/20		1	1		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/4/21	2016/4/28	0.86	0	0				

●2016年4月20日の予定

*3月の貿易統計(財務省 8:50)	*3月の米中古住宅販売	*交付税特別会計借入(10,500億円、4/28借入)
--------------------	-------------	-----------------------------

◆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