Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●貝並帯桁							
**	2016年	5月2日	2016年	5月6日	2016年5月9日		
単位:億円	需給	速報	需給	予想	当社予想		
銀行券		▲ 100		2, 500	4, 000		
財政	•	24, 800	4	8, 900	▲ 39,000		
資金過不足	A	24, 900	1	6, 400	▲ 35,000		
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	1, 800	▲ 9, 700			2, 900	▲ 3, 200	
国債買現							
国庫短期証買入					20, 000		
国債買入					4, 700		
CP等買入		▲ 500		▲ 800			
貸出支援基金(成)							
貸出支援基金(貸)							
被災地支援							
社債等買入							
ETF買入			100				
国債補完供給	▲ 100	300		100			
当預増減	A	33, 100		7,000	A	10, 600	
当座預金残高	2, 8	311, 000	2,	804, 000	2,	793, 400	
準備預金残高	2, 5	536, 800					
積み終了先	2, (083, 600		5月6日以	降の残り所	要積立額	
超過準備	2, (083, 400		積数		900	
非準備預金先	1	274, 200		1日平均		100	
積み期間(4/16~	$5/15) \sigma$	所要準(備額		2, 046, 800		
準備預金進捗率	実績		99.96%	日数		66.67%	

●2016年5月2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、前営業日比1兆9.000億円減の208 兆3,000億円(当座預金残高見込みは281兆3,000億円)。本日の無担O/N は、邦銀・証券業態による▲0.075~▲0.07%での調達で始まった。先週末と 比べ、調達ニーズは弱く、その後は▲0.075~▲0.06%程度での出合いが散 見されるなか本日の取引を終えた。ターム物は、1W物で▲0.06%近辺での 出合いが見られた。

〈レポ市場〉

5/2のGC T/N(5/6-5/9)は、▲0.085~▲0.07%程度の出合い。S/N(5/9-5/10)は、▲0.09~▲0.075%程度の出合い。T/N、S/Nともに投資家の資金 調達意欲がしっかりで、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短国買入オペが前 回比5,000億円増額の20,000億円でオファーされた。前回は対象外となって いた3M(603回)が対象銘柄となり、応募限度額は今回もオファー額の4分の 1に設定された。オファー額が多めであったことや、マーケットの需給が良好 なことから、平均利回較差+0.012%、按分利回較差▲0.009%と落ち着いた 結果になった。その他は、1Y物で前場に▲0.296%の出合いが見られた程度 と閑散であった。

〈CP市場〉

発行市場は大型連休の谷間にあたり閑散であった。償還総額は200億円程 度にとどまった。

JGB新発10年債

●短期金融市場関連指標

2016/5/2	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	0.000	▲ 0.067				-	▲ 0.074
T/N							-	▲ 0.076
S/N							_	-
1W	▲ 0.070	0.000	▲ 0.057				-	▲ 0.109
2W	▲ 0.065	▲ 0.060	▲ 0.062				-	▲ 0.117
3W							-	▲ 0.123
1M			0.000				-	▲ 0.135
3M							▲ 0.285	▲ 0.193
6M							▲ 0.305	▲ 0.206
1Y							▲ 0.296	▲ 0.213

直迫	近値	前	日比	15	15時時点		前日比		為替(9時)	為替(17時)		
A (0.115	A (0.030 1		6,147.38		▲ 518.67		106.44-47	106.39-41		
日付			4/2	2 4/25			4/26		4/27	4/28		
日銀当	日銀当預残		2,823,	300 2,820,9		00	2,852,900		2,839,200	2,844,100		
準備剂	準備預金残		2,533,	900	2,538,900		2,561,100		2,539,800	2,545,700		
マネタ	マネタリーベース		3,828,100		3,827,000		3,862,300		3,852,700	3,861,900		
無担C	無担O/N加重平均		▲0.080%		▲0.075%		▲0.067%		6 ▲0.058%	▲0.056%		
コール	コール市場残高		50,327		57,219		56,115		53,292	61,063		
	ゔ゙゙゙゙゙゙	ち無担	37,90		43,5	45	43,4	17	7 41,779	46,736		
	うす	ち有担	12,	421	13,6	74	12,69	98	11,513	14,327		

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)	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)
	+p/+pa/- 1.7 =											<u> </u>	

本日は財務省による国債等の人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
共通担保資金供給(全店) < 固定金利方式>	8,000	2016/5/9	2016/5/23		2,880	2,880				
国庫短期証券買入	20,000	2016/5/9			37,275	20,001	▲0.009		0.012	54.5
国債買入(残存期間1年以下)	700	2016/5/9			1,478	701	▲0.025		▲0.008	53.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,400	2016/5/9			8,138	2,404	▲0.053		▲0.046	32.4
国債買入(残存期間25年超)	1,600	2016/5/9			5,360	1,601	▲0.090		▲0.064	34.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	674	2016/5/2	2016/5/6		68	68		▲0.600	▲0.600	

■2016年5月3日の予定

●2016年5月4日の予定

●2016年5月5日の予定

*憲法記念日

*みどりの日 *米国3月の貿易収支

*米国3月の製造業新規受注・出荷・在庫

*米国4月のISM非製造業景況指数

- *4日のマネタリーベー
- *米国3月の消費者信用残高
- *流動性供給入札

*こどもの日

(2,000億円、5/10発行)

- ●2016年5月6日の予定
 - *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み
- *米国4月の雇用統計

- ◆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