

# Central Daily Market Report

2016年5月9日(月)

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5月9日		2016年5月10日		2016年5月11日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,700		3,900		2,000	
財政	▲ 23,500		2,500		1,000	
資金過不足	▲ 19,800		6,400		3,000	
<b>金融調節</b>						
	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
<b>貸出</b>						
全店共通	2,900	▲ 3,200				
国債買現						
国庫短期証買入	20,000					
国債買入	5,700				11,900	
CP等買入		▲ 300		▲ 400		
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	200					
国債補完供給	▲ 200	500		200		
当預増減	5,800		6,200		14,900	
<b>当座預金残高</b>						
当座預金残高	2,810,900		2,817,100		2,832,000	
準備預金残高	2,533,700					
積み終了先	2,083,400			5月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,083,400			積数	300	
非準備預金先	277,200			1日平均	100	
<b>積み期間(4/16~5/15)の所要準備額</b>						
所要準備額						2,046,800
<b>準備預金進捗率</b>						
実績	99.99%		日数	80.00%		

## ●2016年5月9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3,000億円増の208兆円(当座預金残高見込みは281兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.075~▲0.04%での調達で始まった。税揚げ日にあたり、調達ニーズが強く、一巡後も同水準で散発的な出合いが続かなか、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

### <レポ市場>

5/9のGC T/N(5/10-5/11)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。S/N(5/11-5/12)は、▲0.095~▲0.085%程度の出合い。T/N、S/Nともに特段大きな要因が無くほぼ同水準での引合いとなっている。SCは個別銘柄では10y336~342、30y49~30y50、40y8などにビッドが多い。

### <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のない中、オファーとビッドが寄り付かず、終日閑散となった。

### <CP市場>

発行市場は償還総額1,000億円程度に対し、発行総額300億円程度。連休明けとなったものの、案件に乏しく閑散であった。発行レートは0%近辺と、横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2016/5/9	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	0.000	▲ 0.066				-	▲ 0.087	▲ 0.110	0.010	16,216.03	109.31	107.35-37	107.65-67
T/N							-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	0.000	▲ 0.046				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.040	0.050	0.005				-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.284	▲ 0.193						
6M							▲ 0.293	▲ 0.208						
1Y							▲ 0.297	▲ 0.215						
日付		4/26	4/27	4/28	5/2	5/6								
日銀当預残	2,852,900	2,839,200	2,844,100	2,811,000	2,805,100									
準備預金残	2,561,100	2,539,800	2,545,700	2,536,700	2,530,000									
マネタリーベース	3,862,300	3,852,700	3,861,900	3,828,900	3,820,100									
無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.058%	▲0.056%	▲0.067%	▲0.066%									
コール市場残高	56,115	53,292	61,063	63,701	62,459									
うち無担	43,417	41,779	46,736	44,598	48,777									
うち有担	12,698	11,513	14,327	19,103	13,682									

## ●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	入札総額(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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2016/5/11			12,276	3,507	▲0.003		0.000	39.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/5/11			15,664	4,404	▲0.002		0.000	18.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,400	2016/5/11			7,145	2,405	0.003		0.006	17.4
国債買入(残存期間25年超)	1,600	2016/5/11			5,936	1,602	▲0.017		▲0.009	7.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	36,747	2016/5/9	2016/5/10		153	153		▲0.600	▲0.600	

## ●2016年5月10日の予定

*米国3月の卸売売上高	*国庫短期証券(605回)入札 (3ヶ月、44,000億円、5/12発行)	*交付税特別会計借入 (10,500億円、5/17借入)
	*10年利付国債入札 (24,000億円、5/12発行)	

◆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