

Central Daily Market Report

2016年5月10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5月10日		2016年5月11日		2016年5月12日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	3,900		3,000		2,000	
財政	1,200		▲1,400		▲33,000	
資金過不足	5,100		1,600		▲31,000	
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						
国債買入			13,100			
CP等買入		▲400		▲200		
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						
国債補完供給	▲1,000	200		1,000		
当預増減	3,900		15,500		▲31,000	
当座預金残高	2,814,800		2,830,300		2,799,300	
準備預金残高	2,542,300					
積み終了先	2,091,400				5月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,091,200				積数	200
非準備預金先	272,500				1日平均	0
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額						2,060,400
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	83.33%		

●2016年5月10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1兆8,000億円増の209兆8,000億円(当座預金残高見込みは281兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.086~▲0.05%での調達で始まった。一巡後も調達ニーズは底堅く▲0.075~▲0.04%での出合いが見られるなか、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームでの出合いが数件見られた。

<レポ市場>

5/10のGC T/N(5/11-5/12)は、▲0.10~▲0.085%程度の出合い。S/N(5/12-5/13)は、▲0.09~▲0.08%程度の出合い。S/Nは10年債とTDB3M物の発行要因で、業者の売物が増加している。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3M物の入札が実施された。WI取引で出合いが見られない中、平均落札利回▲0.2375%、按分落札利回▲0.2197%と前回債に次ぐ強めの結果となった。セカンダリーは▲0.24%が出合った程度と小動きであった。

<CP市場>

発行市場は償還総額500億円程度に対し、石油業態から大型発行案件が見られ、発行総額は900億円程度となった。発行レートは一部銘柄で小幅に上昇した。CP等買入オベは前回比1,000億円減額の3,000億円でオファーされた。結果は平均・按分落札利回共に▲0.002%と前回比で上昇した。

●短期金融市場関連指標

2016/5/10	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	0.001	▲0.068				-	▲0.090	▲0.100	0.010	16,565.19	349.16	108.36-38	108.88-90
T/N							-	▲0.096						
S/N							-	-						
1W	▲0.055	0.110	▲0.011				-	▲0.096						
2W			0.230				-	▲0.104						
3W							-	▲0.112						
1M							-	▲0.122						
3M							▲0.238	▲0.191						
6M							▲0.282	▲0.202						
1Y							▲0.295	▲0.215						
									日付	4/27	4/28	5/2	5/6	5/9
									日銀当預残	2,839,200	2,844,100	2,811,000	2,805,100	2,810,900
									準備預金残	2,539,800	2,545,700	2,536,700	2,530,000	2,533,700
									マネタリーベース	3,852,700	3,861,900	3,828,900	3,820,100	3,822,100
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.056%	▲0.067%	▲0.066%	▲0.066%
									コール市場残高	53,292	61,063	63,701	62,459	64,786
									うち無担	41,779	46,736	44,598	48,777	51,215
									うち有担	11,513	14,327	19,103	13,682	13,571

●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	案分率	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)
国庫短期証券	605	-	43,700	2016/5/12	2016/8/8	186,316.0	39,801.9	100.0530	▲0.2197%	42.3076%	100.0573	▲0.2375%	3,898.0
10年利付国債	342	0.10%	24,000	2016/5/12	2026/3/20	74,909.0	21,800.0	101.9000	▲0.0910%	96.8271%	101.9500	▲0.0960%	2,181.0
交付税特会	-	-	10,500	2016/5/17	2016/11/17	64,225.0	10,500.00		0.0010%	16.3489%		0.0010%	

●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
CP等買入	3,000	2016/5/13			11,503	2,994	▲0.002		▲0.002	85.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	53,247	2016/5/10	2016/5/11		944	944		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/5/12	2016/5/19	0.87	1	1				

●2016年5月11日の予定

*3月の景気動向指数速報	*米国4月の財政収支	*国庫短期証券(606回)入札(6ヶ月、35,000億円、5/13発行)
*4月のマネタリーベースと日本銀行の取引		

◆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お客様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