Central Daily Market Report

2016年5月11日（水）
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11日 需給速報		2016年5月12日 需給予想		2016年5月13日 当社予想	
銀行券	3,200		1,400		2,000	
財政	700		▲ 34,800		▲ 27,000	
資金過不足	3,900		▲ 33,400		▲ 25,000	
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				12,400	
CP等買入		▲ 200		▲ 200	3,000	
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	▲ 100	1,000		100		
当預増減	17,700		▲ 33,500		▲ 9,600	

当座預金残高	2,832,500	2,799,000	2,789,400
準備預金残高	2,550,400		
積み終了先	2,101,000		
超過準備	2,101,000		
非準備預金先	282,100		

5月12日以降の残り所要積立額	
積数	100
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 100.00%　日数	86.67%

●2016年5月11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2,000億円増の210兆円(当座預金残高見込みは283兆円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.075～▲0.03%での調達で始まった。積み最終日を週末に控え、地銀業態を中心に調達ニーズが強く、一巡後も同水準での出合いが続くなか、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>

5/11のGC T/N(5/12-5/13)は、▲0.085～▲0.07%程度の出合い。S/N(5/13-5/16)は、▲0.08～▲0.06%程度の出合い。S/Nは投資家、業者ともに資金調達意欲が強くレートは上昇傾向での推移となった。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6M物の入札が実施された。WI取引で▲0.275%の出合いが見られ、平均落札利回▲0.2939%、按分落札利回▲0.2819%と事前予想よりも強い結果となった。セカンダリーは▲0.4%の出合いが見られた程度と小動きであった。

<CP市場>

発行市場は償還総額700億円程度に対し、石油・不動産業態から大型発行案件が見られ、発行総額は1,000億円程度となった。発行レートは低位横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/5/11	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.065				－	▲ 0.085
T/N			▲ 0.070				－	▲ 0.077
S/N							－	－
1W	▲ 0.050	0.010	▲ 0.010				－	▲ 0.095
2W							－	▲ 0.101
3W							－	▲ 0.110
1M							－	▲ 0.117
3M							▲ 0.238	▲ 0.198
6M							▲ 0.376	▲ 0.204
1Y							▲ 0.295	▲ 0.215

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
▲ 0.105	▲ 0.005	16,579.01	13.82	109.21-23	108.60-62

日付	4/28	5/2	5/6	5/9	5/10
日銀当預残	2,844,100	2,811,000	2,805,100	2,810,900	2,814,800
準備預金残	2,545,700	2,536,700	2,530,000	2,533,700	2,542,300
マネタリーベース	3,861,900	3,828,900	3,820,100	3,822,100	3,822,100
無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.067%	▲0.066%	▲0.066%	▲0.068%
コール市場残高	61,063	63,701	62,459	64,786	65,264
うち無担	46,736	44,598	48,777	51,215	51,749
うち有担	14,327	19,103	13,682	13,571	13,515

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	606	－	35,000	2016/5/13	2016/11/10	167,630.1	31,827.9	100.1400	▲0.2819%	15.9012%	100.1460	▲0.2939%	3,172.0

●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	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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	3,500	2016/5/13			11,668	3,502	0.002		0.003	67.1
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,400	2016/5/13			20,460	4,409	▲0.002		▲0.001	51.0
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,500	2016/5/13			13,372	4,505	▲0.006		▲0.004	25.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	8,665	2016/5/11	2016/5/12		66	66		▲0.600	▲0.600	

●2016年5月12日の予定

*リテール決済カンファレンスにて中曽副総裁講演
*決定会合における主な意見(4月27・28日分)
*3月の国際収支(財務省所管・日銀作成)
*4月の景気ウォッチャー調査(内閣府)
*英中銀MPC結果発表
*国庫短期証券（607回）入札
（3ヶ月、44,000億円、5/16発行）
*30年利付国債入札
（8,000億円、5/16発行）
*エネルギー対策借入
（6,000億円、5/20借入）

◆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