Central Daily Market Report

2016年5月12日（木）
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12日 需給速報		2016年5月13日 需給予想		2016年5月16日 当社予想	
銀行券	1,600		900		1,000	
財政	▲ 38,300		▲ 23,800		▲ 14,000	
資金過不足	▲ 36,700		▲ 22,900		▲ 13,000	
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					2,800	▲ 1,800
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,600			
CP等買入		▲ 200	3,000	▲ 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						
ＥＴＦ買入			1,000			
国債補完供給		100				
当預増減	▲ 36,800		▲ 6,700		▲ 12,000	

当座預金残高	2,795,700	2,789,000	2,777,000
準備預金残高	2,516,900		
積み終了先	2,060,300		
超過準備	2,060,300		
非準備預金先	278,800		

5月13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 90.00%

●2016年5月12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3兆8,000億円減の206兆2,000億円(当座預金残高見込みは279兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.07～▲0.04%での調達で始まった。昨日と同様に、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、ロール案件が数件見られた。

<レポ市場>

5/12のGC T/N(5/13-5/16)は、▲0.06～▲0.04%程度の出合い。S/N(5/16-5/17)は、▲0.06～▲0.04%程度の出合い。T/N、S/NともにTDB連続発行の影響で業者の売物が多い。SCは個別銘柄では10y336～342、30y49、40y8などにビッドが見られている。

<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▲0.225%の出合いが見られる中、平均落札利回▲0.2313%、按分落札利回▲0.2204%と概ね前回の3M物と並ぶ強めの結果となった。セカンダリーは▲0.25～▲0.245%の出合いが見られた程度と小動きだった。その他、引け際に、明日のオペを睨んでか、6M物が▲0.356%から▲0.425%まで買い進まれていた。

<CP市場>

発行市場は償還総額2,800億円程度に対し、鉄鋼・石油業態で大型発行が見られたが、発行件数少なく、五・十日に係る発行ではあったものの発行総額は1,300億円程度とそれほど膨らまなかった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/5/12	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	▲ 0.063				－	▲ 0.079
T/N	▲ 0.068	0.000	▲ 0.058				－	▲ 0.056
S/N							－	－
1W	▲ 0.060	0.000	▲ 0.046				－	▲ 0.094
2W	▲ 0.010	0.200	0.025				－	▲ 0.100
3W							－	▲ 0.107
1M			0.225				－	▲ 0.115
3M							▲ 0.249	▲ 0.199
6M							▲ 0.420	▲ 0.205
1Y							▲ 0.295	▲ 0.217

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)
▲ 0.115	▲ 0.010	16,646.34	67.33	108.42-44	108.92-94

日付		5/2	5/6	5/9	5/10	5/11
日銀当預残		2,811,000	2,805,100	2,810,900	2,814,800	2,832,500
準備預金残		2,536,700	2,530,000	2,533,700	2,542,300	2,550,400
マネタリーベース		3,828,900	3,820,100	3,822,100	3,822,100	3,836,700
無担O/N加重平均		▲0.067%	▲0.066%	▲0.066%	▲0.068%	▲0.065%
コール市場残高		63,701	62,459	64,786	65,264	64,479
	うち無担	44,598	48,777	51,215	51,749	52,426
	うち有担	19,103	13,682	13,571	13,515	12,053

●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	607	－	43,600	2016/5/16	2016/8/15	199,274.0	39,635.6	100.0550	▲0.2204%	76.5067%	100.0577	▲0.2313%	3,964.0
30年利付国債	50	0.80%	8,000	2016/5/16	2046/3/20	22,082.0	7,337.0	112.7000	0.3320%	79.6078%	113.1000	0.3190%	657.0
エネルギー対策	－	－	6,000	2016/5/20	2017/5/22	31,542.0	5,999.99		0.0010%	19.0224%		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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2016/5/16	2016/5/30		2,830	2,830				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	11,105	2016/5/12	2016/5/13		24	24		▲0.600	▲0.600	

●2016年5月13日の予定

*内外情勢調査会にて黒田総裁講演
*4月のマネーストック
*3月の特定サービス産業動態統計速報
*3月の第3次産業活動指数
*3月の米企業在庫
*4月の米生産者物価指数
*4月の米小売売上高
*5月のミシガン大消費者信頼感指数速報
*1-3月期のユーロ圏GDP速報値

◆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