

Central Daily Market Report

2016年5月13日(金)

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13日 | | 2016年5月16日 | | 2016年5月17日 | |
|-----------------------|------------|-------|-----------------|---------|------------|-----|
| | 需給速報 | | 需給予想 | | 当社予想 | |
| 銀行券 | 1,000 | | 1,900 | | 0 | |
| 財政 | ▲ 24,300 | | ▲ 17,800 | | 2,000 | |
| 資金過不足 | ▲ 23,300 | | ▲ 15,900 | | 2,000 | |
| 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 | | | | | 30,000 | |
| 国債買入 | 12,600 | | | | 8,500 | |
| CP等買入 | 3,000 | ▲ 400 | | ▲ 1,200 | | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | |
| 被災地支援 | | | | | | |
| 社債等買入 | | | | | | |
| E T F買入 | 1,000 | | 300 | | | |
| 国債補完供給 | | | | | | |
| 当預増減 | ▲ 7,100 | | ▲ 15,800 | | 40,500 | |
| 当座預金残高 | 2,788,600 | | 2,772,800 | | 2,813,300 | |
| 準備預金残高 | 2,524,300 | | | | | |
| 積み終了先 | 2,069,000 | | 5月16日以降の残り所要積立額 | | | |
| 超過準備 | 2,069,000 | | 積数 | | 2,132,500 | |
| 非準備預金先 | 264,300 | | 1日平均 | | 68,800 | |
| 積み期間(5/16~6/15)の所要準備額 | | | | | 2,132,500 | |
| 準備預金進捗率 | 実績 | 0.00% | 日数 | 0.00% | | |

●2016年5月13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1,000億円増の206兆3,000億円(当座預金残高見込みは278兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.086~▲0.04%での調達で始まった。実質的な積み最終日となり、邦銀勢からの調達ニーズが強く、その後は▲0.065~▲0.03%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>

5/13のGC T/N(5/16-5/17)は、▲0.06~▲0.05%程度の出合い。S/N(5/17-5/18)は、▲0.075~▲0.065%程度の出合い。S/Nは日銀による短国買入オペが通知された影響でレートは低下傾向となった。SCは個別銘柄では10y336~342、30y49~50、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短国買入オペが前回比10,000億円増額の30,000億円と概ね予想通りの金額でオファーされた。1社あたりの応札上限が前回の4分の1から2分の1へと変更され、引け値が低かった銘柄を中心に応札されたためか、平均利回較差+0.034%、按分利回較差+0.023%となった。その他、3M物で▲0.28~▲0.25%の出合いが見られた。

<CP市場>

発行市場は償還総額300億円弱に対し、発行総額200億円弱と超閑散であった。発行レートは積極的な応札は見られず、小幅に上昇した。

●短期金融市場関連指標

| 2016/5/13 | 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) | 為替(17時) | |
| O/N | ▲ 0.086 | 0.001 | ▲ 0.055 | | | | - | ▲ 0.076 | ▲ 0.115 | 0.000 | 16,412.21 | ▲ 234.13 | 109.09-11 | 108.78-80 | | |
| T/N | | | ▲ 0.060 | | | | - | ▲ 0.055 | | | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | | | |
| 1W | | | 0.000 | | | | - | ▲ 0.095 | | | | | | | | |
| 2W | | | 0.000 | | | | - | ▲ 0.100 | | | | | | | | |
| 3W | | | ▲ 0.050 | | | | - | ▲ 0.108 | | | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲ 0.115 | | | | | | | | |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.260 | ▲ 0.200 | | | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.411 | ▲ 0.203 | | | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.295 | ▲ 0.212 | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | 日付 | 5/6 | 5/9 | 5/10 | 5/11 | 5/12 |
| | | | | | | | | | | | 日銀当預残 | 2,805,100 | 2,810,900 | 2,814,800 | 2,832,500 | 2,795,700 |
| | | | | | | | | | | | 準備預金残 | 2,530,000 | 2,533,700 | 2,542,300 | 2,550,400 | 2,516,900 |
| | | | | | | | | | | | マネタリーベース | 3,820,100 | 3,822,100 | 3,822,100 | 3,836,700 | 3,798,200 |
| | | | | | | | | | | | 無担O/N加重平均 | ▲0.066% | ▲0.066% | ▲0.068% | ▲0.065% | ▲0.063% |
| | | | | | | | | | | | コール市場残高 | 62,459 | 64,786 | 65,264 | 64,479 | 65,529 |
| | | | | | | | | | | | うち無担 | 48,777 | 51,215 | 51,749 | 52,426 | 51,878 |
| | | | | | | | | | | | うち有担 | 13,682 | 13,571 | 13,515 | 12,053 | 13,651 |

●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 | 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 |
|---------------------------|----------------|-----------|-----------|------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国庫短期証券買入 | 30,000 | 2016/5/17 | | | 77,327 | 30,001 | 0.023 | | 0.034 | 99.5 |
| 国債買入(残存期間5年超10年以下) | 4,500 | 2016/5/17 | | | 12,756 | 4,508 | ▲0.003 | | ▲0.002 | 53.6 |
| 国債買入(残存期間10年超25年以下) | 2,400 | 2016/5/17 | | | 6,018 | 2,403 | 0.008 | | 0.012 | 72.4 |
| 国債買入(残存期間25年超) | 1,600 | 2016/5/17 | | | 5,514 | 1,604 | 0.015 | | 0.019 | 92.7 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 8,665 | 2016/5/13 | 2016/5/16 | | 20 | 20 | | ▲0.600 | ▲0.600 | |

●2016年5月16日の予定

| | |
|---------------|------------|
| *3月の石油等消費動態統計 | *4月の企業物価指数 |
|---------------|------------|

◆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