

# Central Daily Market Report

2016年5月16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16日		2016年5月17日		2016年5月18日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,000		1,300		0	
財政	▲ 18,100		5,600		1,000	
資金過不足	▲ 16,100		6,900		1,000	
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			9,200			
CP等買入		▲ 1,200		▲ 100		
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	300		100			
国債補充供給	▲ 100			100		
当預増減	▲ 16,100		46,200		1,000	
当座預金残高	2,772,500		2,818,700		2,819,700	
準備預金残高	2,505,900					
積み終了先	794,500		5月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	592,600		積数		674,100	
非準備預金先	266,600		1日平均		22,500	
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	68.39%	日数	3.23%		

## ●2016年5月16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5,000億円増の206兆8,000億円(当座預金残高見込みは277兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.07~▲0.045%での調達で始まったが、積みの初日ということで、ビッドサイドが少なく、様子見姿勢でのスタートとなった。その後は、▲0.05%の出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件での出合いが散見される程度であった。

### <レポ市場>

5/16のGC T/N(5/17-5/18)は、▲0.08~▲0.07%程度の出合い。S/N(5/18-5/19)は、▲0.08~▲0.07%程度の出合い。S/Nは特段の需給要因も無いことから前日と横ばいで推移し、引き続き比較的売り物の多い地合いとなっていた。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>

短国現先レートT/Nは、前日の短国買入オペの影響もあり、小幅にレートが低下した。短国アウトライト市場は、3Mが▲0.28%、6Mが▲0.39%、1Yが▲0.29%でそれぞれ散発的な出合いが見られたが、総じて閑散との印象であった。

### <CP市場>

CP市場は償還総額500億円程度に対し、発行総額は800億円程度だった。鉄鋼、商社等からのまとまった発行案件があったが、案件数は少なく、閑散との印象であった。発行レートは引き続き0%近辺の決着であった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/5/16	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	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.084	▲ 0.115	0.000	16,466.40	54.19	108.66-68	108.76-78
T/N							-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W			0.250				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.001	0.100	0.033				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.108						
1M			0.100				-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.266	▲ 0.199						
6M							▲ 0.409	▲ 0.205						
1Y							▲ 0.295	▲ 0.216						
									日付	5/9	5/10	5/11	5/12	5/13
									日銀当預残	2,810,900	2,814,800	2,832,500	2,795,700	2,788,600
									準備預金残	2,533,700	2,542,300	2,550,400	2,516,900	2,524,300
									マネタリーベース	3,822,100	3,822,100	3,836,700	3,798,200	3,790,100
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.068%	▲0.065%	▲0.063%	▲0.055%
									コール市場残高	64,786	65,264	64,479	65,529	69,241
									うち無担	51,215	51,749	52,426	51,878	52,514
									うち有担	13,571	13,515	12,053	13,651	16,727

## ●入札結果

名称	回数	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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	24,133	2016/5/16	2016/5/17		24	24		▲0.600	▲0.600	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,468	2016/5/16	2016/5/17		33	33		▲0.600	▲0.600	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
被災地金融支援オペ	第61回	2016/5/20	2017/5/19	0						

## ●2016年5月17日の予定

*3月のマネタリーサーベイ	*米国4月の消費者物価指数	*5年利付国債入札(24,000億円、5/19発行)
	*米国4月の住宅着工件数	*国有林野借入(552億円、5/25借入)
	*米国4月の鉱工業生産・設備稼働率	
	*英国4月の消費者物価指数	

◆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