Central Daily Market Report

2016年5月18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18日 需給速報		2016年5月19日 需給予想		2016年5月20日 当社予想	
銀行券	700		▲ 300		▲ 2,000	
財政	2,900		▲ 28,500		▲ 18,000	
資金過不足	3,600		▲ 28,800		▲ 20,000	
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					12,400	
CP等買入		▲ 200		▲ 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	▲ 200	200		200		
当預増減	3,400		▲ 28,800		▲ 7,600	

当座預金残高	2,822,100	2,793,300	2,785,700
準備預金残高	2,552,300		
積み終了先	2,025,400		
超過準備	1,988,100		
非準備預金先	269,800		

5月19日以降の残り所要積立額	
積数	140,300
1日平均	5,000

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	93.42%	日数 9.68%

●2016年5月18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210兆円(当座預金残高見込みは282兆円)。本日の無担O/Nは、昨日と同様、▲0.05%のオファーに対し、▲0.06%のビッドで始まった。その後は邦銀、証券の▲0.06～▲0.045%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後に入ると、▲0.05%近辺の調整程度の出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートターム物で▲0.05%近辺での出合いが散見された。

<レポ市場>

5/18のGC T/N(5/19-5/20)は、▲0.07～▲0.065%程度の出合い。S/N(5/20-5/23)は、▲0.065～▲0.06%程度の出合い。S/Nは短国1Y物の発行があり、比較的売り物が多く、▲0.06%台までレートは上昇した。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、前日から横ばい圏のレート気配であった。短国1Y物の入札は按分▲0.3152%、平均▲0.3251%、按分比率60.09%と堅調な結果で、セカンダリーでは▲0.368～▲0.35%の出合いが見られた。その他、カレント銘柄では目立った出合いが聞かれなかった。

<CP市場>

CP市場は償還総額1,200億円程度に対し、発行総額は1,500億円程度となった。五・十日発行にあたったことで発行案件が多く、石油、建設、鉄鋼等の業態からのまとまった発行が見られた。発行レートは引き続き0%近辺が中心となった。CP等買入オペは、先月末時点の予定より500億円増額の4,000億円で通知され、按分・平均共に▲0.001%、按分比率65.8%という結果であった。

●短期金融市場関連指標

2016/5/18	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	▲ 0.010	▲ 0.059				－	▲ 0.074
T/N	▲ 0.060	▲ 0.015	▲ 0.058				－	▲ 0.066
S/N							－	－
1W	▲ 0.050	▲ 0.020	▲ 0.043				－	▲ 0.090
2W			0.000				－	▲ 0.097
3W							－	▲ 0.105
1M							－	▲ 0.112
3M							▲ 0.265	▲ 0.197
6M							▲ 0.406	▲ 0.208
1Y							▲ 0.358	▲ 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	0.010	16,644.69	▲ 8.11	109.02-03	109.42-44

日付	5/11	5/12	5/13	5/16	5/17
日銀当預残	2,832,500	2,795,700	2,788,600	2,772,500	2,818,700
準備預金残	2,550,400	2,516,900	2,524,300	2,505,900	2,555,600
マネタリーベース	3,836,700	3,798,200	3,790,100	3,772,000	3,816,700
無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.063%	▲0.055%	▲0.063%	▲0.058%
コール市場残高	64,479	65,529	69,241	56,662	60,193
うち無担	52,426	51,878	52,514	40,600	45,456
うち有担	12,053	13,651	16,727	16,062	14,737

●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	608	－	25,000	2016/5/20	2017/5/22	140,501.0	22,724.9	100.3180	▲0.3152%	60.0900%	100.3280	▲0.3251%	2,275.0

●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	2016/5/20			18,558	3,502	0.007		0.008	28.4
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,400	2016/5/20			16,720	4,409	0.005		0.006	45.0
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,500	2016/5/20			14,513	4,507	0.005		0.006	79.0
CP等買入	4,000	2016/5/23			9,619	3,984	▲0.001		▲0.001	65.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	28,610	2016/5/18	2016/5/19		173	173		▲0.600	▲0.600	

●2016年5月19日の予定

*3月の機械受注統計
*国庫短期証券（609回）入札
（3ヶ月、44,000億円、5/23発行）
*20年利付国債入札
（11,000億円、5/23発行）
*交付税特別会計借入
（10,500億円、5/27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