

# Central Daily Market Report

2016年5月20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20日		2016年5月23日		2016年5月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 300		700			0
財政	▲ 19,500		▲ 5,400			1,000
資金過不足	▲ 19,800		▲ 4,700			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			5,600	▲ 5,200		
国債買現						
国庫短期証買入					30,000	
国債買入	12,600				11,900	
CP等買入		▲ 700	4,000	▲ 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	100					
国債補完供給		200				
当預増減	▲ 7,600		▲ 400			42,900
当座預金残高	2,785,400		2,785,000			2,827,900
準備預金残高	2,514,100					
積み終了先	2,051,900				5月23日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,044,800				積数	40,700
非準備預金先	271,300				1日平均	1,700
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	98.09%	日数	22.58%		

## ●2016年5月20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5,000億円減の206兆4000億円(当座預金残高見込みは278兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.045%のオファーに対し、▲0.05%のビッドで始まった。その後は邦銀、証券の▲0.05~▲0.04%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見られつつ、今週の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

### <レポ市場>

5/20のGC T/N(5/23-5/24)は、▲0.055~▲0.05%程度の出合い。S/N(5/24-5/25)は、▲0.085~▲0.075%程度の出合い。S/Nは国債・短国買入オペが通知されたことで売り物が減少し、レートは低下した。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、短国3M物の発行要因から、前日比で小幅にレートが上昇した。アウトライト市場では3M物で▲0.26~▲0.259%、1Y物で▲0.363~▲0.362%の出合いが見られた。短国買入オペが3兆円オファーされ、按分利回較差0.00%、平均利回較差+0.016%、按分比率84.0%と、概ね事前の予想通りの無難な結果となった。

### <CP市場>

CP市場は償還総額300億円程度に対し、発行総額は200億円程度だった。大きなイベントが無い中、発行案件も少なく、閑散だった。発行レートは引き続き0%近辺であった。

## ●短期金融市場関連指標

2016/5/20	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	0.000	▲ 0.053				-	▲ 0.067	▲ 0.110	▲ 0.030	16,736.35	89.69	109.92-93	110.27-29
T/N	▲ 0.045	▲ 0.015	▲ 0.033				-	▲ 0.059						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	0.000	▲ 0.018				-	▲ 0.085						
2W			0.000				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.263	▲ 0.197						
6M							▲ 0.376	▲ 0.208						
1Y							▲ 0.360	▲ 0.215						
									日付	5/13	5/16	5/17	5/18	5/19
									日銀当預残	2,788,600	2,772,500	2,818,700	2,822,100	2,793,000
									準備預金残	2,524,300	2,505,900	2,555,600	2,552,300	2,521,400
									マネタリーベース	3,790,100	3,772,000	3,816,700	3,819,500	3,790,600
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.063%	▲0.058%	▲0.059%	▲0.058%
									コール市場残高	69,241	56,662	60,193	59,954	62,116
									うち無担	52,514	40,600	45,456	43,059	44,949
									うち有担	16,727	16,062	14,737	16,895	17,167

## ●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	2016/5/24			61,719	30,003	0.000		0.016	84.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2016/5/24			14,946	3,506	▲0.003		▲0.002	89.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/5/24			13,964	4,409	▲0.010		▲0.009	45.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,400	2016/5/24			5,094	2,402	▲0.023		▲0.015	49.8
国債買入(残存期間25年超)	1,600	2016/5/24			5,903	1,601	▲0.041		▲0.034	60.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,821	2016/5/20	2016/5/23		28	28		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	10,000	2016/5/20	2016/5/23		11	11		▲0.600	▲0.600	

## ●2016年5月23日の予定

*中曾日銀副総裁、慶應義塾大学・ポッコロニ大学共催 日伊国交150周年記念カンファレンスにて講演	*3月の景気動向指数改訂状況 *4月の貿易統計 *月例経済報告
---	---------------------------------------

◆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