# Central Daily Market Report

2016年5月23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23日 需給速報 | 2016年5月24日 需給予想 | 2016年5月25日 当社予想 |
|---|---|---|---|
| 銀行券 | 400 | ▲ 500 | 0 |
| 財政 | ▲ 6,300 | 700 | 0 |
| 資金過不足 | ▲ 5,900 | 200 | 0 |

| 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 | | | 12,500 | | 5,200 | |
| CP等買入 | 4,000 | ▲ 100 | | ▲ 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 | | | 400 | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 200 | | | 200 | | |
| 当預増減 | ▲ 1,800 | | 43,100 | | 5,200 | |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 当座預金残高 | 2,783,600 | 2,826,700 | 2,831,900 |
| 準備預金残高 | 2,514,500 | | |
| 積み終了先 | 2,054,200 | 5月24日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 2,054,200 | 積数 | 33,100 |
| 非準備預金先 | 269,100 | 1日平均 | 1,400 |
| 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 98.45% | 日数 | 25.81% |

## ●2016年5月23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7,000億円増の207兆1,000億円(当座預金残高見込みは278兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.04%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▲0.06～▲0.04%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後は目立った出合いはなく、閑散とした地合いの中、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た。

**<レポ市場>**

5/23のGC T/N(5/24-5/25)は、▲0.080～▲0.075%程度の出合い。S/N(5/25-5/26)は、▲0.085～▲0.080%程度の出合い。SC個別銘柄では10Y336～342、30Y48～50、40Y8などにビッドの出入りが多く見られた。

**<短国市場>**

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低下した。アウトライト市場は前場に3Mゾーンで多少買いがみられた。また、1Y物で▲0.365～▲0.36%の出合いがみられた。

**<CP市場>**

CP市場は25日発行となり、鉄鋼、商社、石油業態等からまとまった発行案件が見られ、発行総額2,500億円程度に膨らんだ。発行レートは引き続き0%近辺で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

| 2016/5/23 | 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 | ▲ 0.057 | | | | － | ▲ 0.075 |
| T/N | ▲ 0.035 | ▲ 0.020 | ▲ 0.030 | | | | － | ▲ 0.080 |
| S/N | | | | | | | － | － |
| 1W | | | | | | | － | ▲ 0.089 |
| 2W | | | ▲ 0.040 | | | | － | ▲ 0.094 |
| 3W | | | | | | | － | ▲ 0.104 |
| 1M | | | | | | | － | ▲ 0.112 |
| 3M | | | | | | | ▲ 0.263 | ▲ 0.198 |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.350 | ▲ 0.209 |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.362 | ▲ 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 | 0.005 | 16,654.60 | ▲ 81.75 | 110.03-04 | 109.54-55 |

| 日付 | 5/16 | 5/17 | 5/18 | 5/19 | 5/20 |
|---|---|---|---|---|---|
| 日銀当預残 | 2,772,500 | 2,818,700 | 2,822,100 | 2,793,000 | 2,785,400 |
| 準備預金残 | 2,505,900 | 2,555,600 | 2,552,300 | 2,521,400 | 2,514,100 |
| マネタリーベース | 3,772,000 | 3,816,700 | 3,819,500 | 3,790,600 | 3,783,300 |
| 無担O/N加重平均 | ▲0.063% | ▲0.058% | ▲0.059% | ▲0.058% | ▲0.053% |
| コール市場残高 | 56,662 | 60,193 | 59,954 | 62,116 | 64,725 |
| うち無担 | 40,600 | 45,456 | 43,059 | 44,949 | 46,226 |
| うち有担 | 16,062 | 14,737 | 16,895 | 17,167 | 18,499 |

## ●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 | 案分率 | 募入平均価格 | 募入平均利回 | 第Ⅰ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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国債買入（残存期間1年以下） | 700 | 2016/5/25 | | | 1,429 | 700 | ▲0.064 | | ▲0.024 | 65.0 |
| 国債買入（残存期間5年超10年以下） | 4,500 | 2016/5/25 | | | 17,383 | 4,506 | ▲0.005 | | ▲0.004 | 27.3 |
| 社債等買入 | 1,000 | 2016/5/27 | | | 1,702 | 1,000 | ▲0.280 | | ▲0.189 | 97.0 |
| 国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分） | 40,000 | 2016/5/23 | 2016/5/24 | | 129 | 129 | | ▲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 | 2016/5/23 | 2016/5/24 | | 11 | 11 | | ▲0.600 | ▲0.600 | |

## ●2016年5月24日の予定

*流動性供給入札
（5,000億円、5/26発行）

*米国4月の新築一戸建て販売件数

◆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