Central Daily Market Report

2016年5月24日（火）
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24日 需給速報		2016年5月25日 需給予想		2016年5月26日 当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 700		▲ 1,000	
財政	0		2,400		10,000	
資金過不足	▲ 600		1,700		9,000	
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	30,000					
国債買入	12,500		5,300			
CP等買入		▲ 200		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
ＥＴＦ買入	400		300			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
当預増減	42,200		6,800		9,000	

当座預金残高	2,825,800	2,832,600	2,841,600
準備預金残高	2,550,600		
積み終了先	2,091,300		
超過準備	2,091,000		
非準備預金先	275,200		

5月25日以降の残り所要積立額	
積数	26,700
1日平均	1,200

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	98.75%	日数 29.03%

●2016年5月24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3兆3,000億円増の210兆4,000億円(当座預金残高見込みは282兆7,000億円)。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～▲0.03%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後は調整の調達も特段見られず、閑散な地合いの中、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートターム物で▲0.03%近辺での出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(5/25-5/26)は、▲0.085～▲0.080%程度の出合い。S/N(5/26-5/27)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は低水準で推移した。アウトライト市場は引き続き3Mゾーンを中心に買いが入っており、3M物では▲0.273～▲0.27%の出合いがみられた。また、その他では1Y物で▲0.362%の出合いが散見された程度であった。

<CP市場>

CP市場はまとまった発行案件が見られず、発行総額400億円程度にとどまった。発行レートは概ね引き続き0%近辺で推移したが、一部の銘柄で小幅上昇する動きが見られた。

●短期金融市場関連指標

2016/5/24	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	▲ 0.055				－	▲ 0.076
T/N			▲ 0.020				－	▲ 0.082
S/N							－	－
1W	▲ 0.038	▲ 0.010	▲ 0.030				－	▲ 0.090
2W			▲ 0.030				－	▲ 0.093
3W			▲ 0.040				－	▲ 0.104
1M			▲ 0.045				－	▲ 0.115
3M							▲ 0.268	▲ 0.198
6M							▲ 0.340	▲ 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)
▲ 0.110	▲ 0.005	16,498.76	▲ 155.84	109.37-38	109.53-54

日付	5/17	5/18	5/19	5/20	5/23
日銀当預残	2,818,700	2,822,100	2,793,000	2,785,400	2,783,600
準備預金残	2,555,600	2,552,300	2,521,400	2,514,100	2,514,500
マネタリーベース	3,816,700	3,819,500	3,790,600	3,783,300	3,781,100
無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.059%	▲0.058%	▲0.053%	▲0.057%
コール市場残高	60,193	59,954	62,116	64,725	59,359
うち無担	45,456	43,059	44,949	46,226	42,325
うち有担	14,737	16,895	17,167	18,499	17,034

●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)
流動性供給	214	－	5,000	2016/5/26	－	20,098.0	4,986.00		▲0.0030%	66.6928%		▲0.0050%	

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	10,000	2016/5/24	2016/5/25		37	37		▲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	2016/5/24	2016/5/25		11	11		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/5/26	2016/6/3	0.86	1	1				

●2016年5月25日の予定

*交付税特別会計借入
（10,500億円、6/3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