

Central Daily Market Report

2016年5月26日(木)

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26日		2016年5月27日		2016年5月30日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 1,100		0	
財政	7,400		2,300		▲ 1,000	
資金過不足	6,400		1,200		▲ 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					2,500	▲ 3,600
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,700			
CP等買入		▲ 100		▲ 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			1,000			
ETF買入						
国債補完供給		100				
当預増減	6,400		14,500		▲ 2,100	
当座預金残高	2,837,000		2,851,500		2,849,400	
準備預金残高	2,555,800					
積み終了先	2,098,200		5月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,098,200		積数		17,600	
非準備預金先	281,200		1日平均		900	
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	99.17%	日数	35.48%		

●2016年5月26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2,000億円増の210兆5,000億円(当座預金残高見込みは283兆7,000億円)。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た。共通担保資金供給オペアは、2W物が8,000億円オファーされ、応札額は2,500億円(期落ち分740億円・2,830億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

GC T/N(5/27-5/30)は、▲0.095~▲0.090%程度の出合い。S/N(5/30-5/31)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3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.270~▲0.260%の出合いがみられ、結果は平均落札利回▲0.2729%、按分落札利回▲0.2605%(按分比率4.0345%)と過去最低利回を大きく更新した。セカンダリーでは▲0.300~▲0.276%と堅調に推移した。また、1Y物はオペアを睨んだ買いからか、▲0.395~▲0.379%と買い進まれている。

<CP市場>

CP市場は、石油、不動産業態等から大型発行案件が見られたものの、償還総額2,200億円程度に対し、発行総額は1,800億円程度にとどまった。発行レートは低位横ばい圏で推移した。また、CP等買入オペアが実施され、オファー額は当初の予定から500億円増額の4,500億円オファーされた。結果は、平均落札利回▲0.004%、按分落札利回▲0.014%となり、前回比(平均・按分共に▲0.001%)で低下した。

●短期金融市場関連指標

2016/5/26	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	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	▲ 0.085	0.000	▲ 0.054				-	▲ 0.084	▲ 0.115	▲ 0.014	16,772.46	15.11	110.13-14	110.02-04
T/N							-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.030				-	▲ 0.097						
2W			0.200				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.108						
1M			▲ 0.023				-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.278	▲ 0.200						
6M							▲ 0.335	▲ 0.210						
1Y							▲ 0.377	▲ 0.217						
									日付	5/19	5/20	5/23	5/24	5/25
									日銀当預残	2,793,000	2,785,400	2,783,600	2,825,800	2,830,600
									準備預金残	2,521,400	2,514,100	2,514,500	2,550,600	2,554,500
									マネタリーベース	3,790,600	3,783,300	3,781,100	3,823,900	3,829,500
									無担O/N加重平均	▲0.058%	▲0.053%	▲0.057%	▲0.055%	▲0.055%
									コール市場残高	62,116	64,725	59,359	63,113	64,091
									うち無担	44,949	46,226	42,325	45,509	47,423
									うち有担	17,167	18,499	17,034	17,604	16,668

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	610	-	44,200	2016/5/30	2016/8/29	193,327.0	40,224.3	100.0650	▲0.2605%	4.0345%	100.0681	▲0.2729%	3,975.0
40年利付国債	9	0.40%	4,000	2016/5/30	2056/3/20	12,260.0	3,994.00	100.0000	0.4000%	39.7380%			

●オペア結果

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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2016/5/30	2016/6/13		2,500	2,500				
CP等買入	4,500	2016/5/31			7,529	4,495	▲0.014		▲0.004	48.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オペア分)	8,902	2016/5/26	2016/5/27		3	3		▲0.600	▲0.600	

●2016年5月27日の予定

*4月全国・5月都都区消費者物価指数(CPI)

市場予想：全 国(4月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.4%
東京都都区(5月)前年同月比(除く生鮮)：▲0.4%

*米国1-3月期のGDP改定値

◆本資料は信頼できるとさ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