

# Central Daily Market Report

2016年5月27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27日		2016年5月30日		2016年5月31日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		600		▲ 400	
財政	100		2,100		3,800	
資金過不足	▲ 1,000		2,700		3,400	
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					20,000	
国債買入	12,700				4,600	
CP等買入		▲ 400		▲ 400	4,500	
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			▲ 100		
E T F買入						
国債補充供給	▲ 200			200		
当預増減	12,100		1,300		32,500	
当座預金残高	2,849,100		2,850,400		2,882,900	
準備預金残高	2,563,800					
積み終了先	2,108,800		5月30日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,106,900		積数		9,600	
非準備預金先	285,300		1日平均		600	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					2,132,700	
準備預金進捗率	実績	99.55%	日数	45.16%		

## ●2016年5月27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5,000億円増の211兆円(当座預金残高見込みは285兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.03%のオファーに対し、▲0.04%のビッドで始まった。その後は邦銀、証券の▲0.05~▲0.025%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後は、閑散な地合いの中、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>

GC T/N(5/30-5/31)は、▲0.085~▲0.080%程度の出合い。S/N(5/31-6/1)は、▲0.105~▲0.100%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。短国買入オペアが2兆円でオファーされ、平均利回較差+0.001%、按分利回較差▲0.010%(按分比率69.3%)と良好な需給を反映した結果となった。オペア後は、3Mの出合いが▲0.280~▲0.279%で散見された程度であった。

### <CP市場>

CP市場は月末発行となり、鉄鋼、建設、機械、ノンバンク等幅広い業態から大型発行案件が見られ、償還総額6,600億円程度に対し、発行総額は8,600億円程度と膨らんだ。発行レートは低位横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2016/5/27	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.049				-	▲ 0.077	▲ 0.120	▲ 0.005	16,834.84	62.38	109.70-72	109.77-78
T/N							-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.003	0.001	0.000				-	▲ 0.099						
2W			0.000				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.109						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.120						
3M							▲ 0.283	▲ 0.200						
6M							▲ 0.331	▲ 0.210						
1Y							▲ 0.384	▲ 0.217						
									日付	5/20	5/23	5/24	5/25	5/26
									日銀当預残	2,785,400	2,783,600	2,825,800	2,830,600	2,837,000
									準備預金残	2,514,100	2,514,500	2,550,600	2,554,500	2,555,800
									マネタリーベース	3,783,300	3,781,100	3,823,900	3,829,500	3,836,800
									無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.057%	▲0.055%	▲0.055%	▲0.054%
									コール市場残高	64,725	59,359	63,113	64,091	68,083
									うち無担	46,226	42,325	45,509	47,423	50,895
									うち有担	18,499	17,034	17,604	16,668	17,188

## ●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	応募総額(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	20,000	2016/5/31			45,472	20,001	▲0.010		0.001	69.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,400	2016/5/31			6,463	2,406	▲0.009		▲0.006	56.1
国債買入(残存期間25年超)	1,600	2016/5/31			3,741	1,602	▲0.031		▲0.023	52.2
国債買入(物価連動債)	600	2016/5/31			2,630	605	▲0.500		▲0.569	85.7
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))	10,000	2016/5/27	2016/5/30		133	133		▲0.600	▲0.600	

## ●2016年5月30日の予定

*4月の商業動態統計速報	*米国祝日(Memorial Day)
	*英国祝日(Spring Bank Holiday)

◆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