

Central Daily Market Report

2016年5月30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30日		2016年5月31日		2016年6月1日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	600		900		1,000	
財政	▲ 1,000		▲ 9,200		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 400		▲ 8,300		▲ 11,000	
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			20,000			
国債買入			5,400		12,400	
CP等買入		▲ 400	4,500	▲ 2,300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
E T F買入						
国債補完供給	▲ 500	200		500		
当預増減	▲ 2,300		19,800		1,400	
当座預金残高	2,846,800		2,866,600		2,868,000	
準備預金残高	2,579,000					
積み終了先	2,126,800			5月31日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,126,800			積数	8,800	
非準備預金先	267,800			1日平均	500	
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	99.59%	日数	48.39%		

●2016年5月30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1兆3,000億円増の212兆3,000億円(当座預金残高見込みは285兆円)。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~▲0.03%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後は調整での出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。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(5/31-6/1)は、▲0.10~▲0.09%程度の出合い。S/N(6/1-6/2)は、▲0.095~▲0.09%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S/Nは下限域で推移。短国市場は、先週末に短国買入オペが行われたことで品薄感が強く、全般的に閑散。3M物で▲0.285%の出合いが見られた程度であった。

<CP市場>

現先レートS/Nは下限域で推移。CP市場は石油、小売を中心にまとまった発行が見られ、発行総額は950億円程度となった。発行レートは引続き0%近辺で推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/5/30	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.079	▲ 0.120	0.000	17,068.02	233.18	110.77-79	111.35-38
T/N	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.013				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.003				-	▲ 0.100						
2W			0.100				-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.110						
1M			▲ 0.032				-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.283	▲ 0.200						
6M							▲ 0.318	▲ 0.210						
1Y							▲ 0.387	▲ 0.217						
									日付	5/23	5/24	5/25	5/26	5/27
									日銀当預残	2,783,600	2,825,800	2,830,600	2,837,000	2,849,100
									準備預金残	2,514,500	2,550,600	2,554,500	2,555,800	2,563,800
									マネタリーベース	3,781,100	3,823,900	3,829,500	3,836,800	3,850,000
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.055%	▲0.055%	▲0.054%	▲0.049%
									コール市場残高	59,359	63,113	64,091	68,083	72,789
									うち無担	42,325	45,509	47,423	50,895	55,314
									うち有担	17,034	17,604	16,668	17,188	17,475

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2016/6/1			17,282	3,504	0.005		0.007	61.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,400	2016/6/1			18,953	4,405	0.005		0.006	49.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,500	2016/6/1			14,548	4,514	0.002		0.003	50.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	30,000	2016/5/30	2016/5/31		343	343		▲0.500	▲0.500	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	29,990	2016/5/30	2016/5/31		15	15		▲0.500	▲0.500	

●2016年5月31日の予定

*4月の完全失業率(市場予想：3.2%)	*米国3月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*4月の全世帯家計調査(市場予想：消費支出、前年比▲1.4%)	*米国4月の個人所得・消費支出
*4月の有効求人倍率(市場予想：1.3倍)	*米国5月のCB消費者信頼感指数
*4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲1.5%)	*米国5月のシカゴPM景況感指数
*4月の住宅着工統計	*ユーロ圏5月の消費者物価指数速報値
*2年利付国債入札(23,000億円、6/15発行)	
*預金保険機構借入(12ヶ月程度、6/10借入)	

◆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お客様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