

Central Daily Market Report

2016年5月6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6日		2016年5月9日		2016年5月10日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	2,900		3,500		3,000	
財政	▲ 7,700		▲ 23,500		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 4,800		▲ 20,000		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			2,900	▲ 3,200		
国債買現						
国庫短期証買入			20,000			
国債買入			5,700			
CP等買入		▲ 800		▲ 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						
E T F買入	100		200			
国債補完供給	▲ 500	100		500		
当預増減	▲ 5,900		5,800		1,000	
当座預金残高	2,805,100		2,810,900		2,811,900	
準備預金残高	2,530,000					
積み終了先	2,077,400			5月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	2,077,400			積数	500	
非準備預金先	275,100			1日平均	100	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					2,046,800	
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	76.67%		

●2016年5月6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6,000億円減の207兆7,000億円(当座預金残高見込みは280兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態による▲0.075~▲0.065%での調達で始まった。前営業日と比べ、ビッドサイドのネーム数が増加したものの、レート水準に大きな変化は無く、その後も同水準での出合いが散見されるなか、本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件が数件見られた。

<レポ市場>

5/6のGC T/N(5/9-5/10)は、▲0.09~▲0.075%程度の出合い。S/N(5/10-5/11)は、▲0.095~▲0.08%程度の出合い。T/N、S/Nともに投資家の資金調達意欲が見られている。SCは個別銘柄では10y336~342、30y49~30y50、40y8などにビッドが多い。

<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1Y物で▲0.296%の出合いが見られた程度と閑散であった。

<CP市場>

発行市場は償還総額2,700億円程度に対し、石油・ノンバンク業態から大型発行案件が見られたものの、大型連休の谷間ということもあり、発行件数は少なく、発行総額は1,000億円弱と閑散だった。発行レートは若干ながら切り上がる動きが複数銘柄で見られたものの、概ね0%近辺での発行となった。

●短期金融市場関連指標

2016/5/6	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.066				-	▲ 0.081	▲ 0.120	▲ 0.005	16,106.72	▲ 40.66	107.34-37	106.94-95
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	0.000	▲ 0.045				-	▲ 0.102						
2W			0.010				-	▲ 0.109						
3W	0.030	0.080	0.044				-	▲ 0.116						
1M							-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.285	▲ 0.191						
6M							▲ 0.303	▲ 0.206						
1Y							▲ 0.297	▲ 0.214						
									日付	4/25	4/26	4/27	4/28	5/2
									日銀当預残	2,820,900	2,852,900	2,839,200	2,844,100	2,811,000
									準備預金残	2,538,900	2,561,100	2,539,800	2,545,700	2,536,700
									マネタリーベース	3,827,000	3,862,300	3,852,700	3,861,900	3,828,900
									無担O/N加重平均	▲0.075%	▲0.067%	▲0.058%	▲0.056%	▲0.067%
									コール市場残高	57,219	56,115	53,292	61,063	63,701
									うち無担	43,545	43,417	41,779	46,736	44,598
									うち有担	13,674	12,698	11,513	14,327	19,103

●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	素分率	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)
流動性供給	213	-	2,000	2016/5/10	-	10,215.0	1,997.00		▲0.0130%	39.1423%		▲0.0180%	

●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)	40,790	2016/5/6	2016/5/9		396	396		▲0.600	▲0.600	

●2016年5月9日の予定

*5月の日銀当座預金増減要因見込み	*4月のFRB 労働市場情勢指数
*金融政策決定会合議事要旨(3月14・15日分)	
*3月の毎月勤労統計調査速報(厚生労働省)	
*4月の消費動向調査(内閣府)	

◆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