Central Daily Market Report

2016年5月17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17日 需給速報		2016年5月18日 需給予想		2016年5月19日 当社予想	
銀行券	1,300		600		▲ 2,000	
財政	5,800		300		▲ 24,000	
資金過不足	7,100		900		▲ 26,000	
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	9,200					
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
ＥＴＦ買入	100					
国債補完供給	▲ 200	100		200		
当預増減	46,200		900		▲ 26,000	

当座預金残高	2,818,700	2,819,600	2,793,600
準備預金残高	2,555,600		
積み終了先	1,954,600		
超過準備	1,677,800		
非準備預金先	263,100		

5月18日以降の残り所要積立額	
積数	251,000
1日平均	8,700

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	88.23%	日数 6.45%

●2016年5月17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3兆1,000億円増の209兆9,000億円(当座預金残高見込みは281兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.05%のオファーに対し、▲0.06%のビッドで始まった。その後は邦銀、証券の▲0.065～▲0.045%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後に入ると、▲0.05%近辺の調整程度の調達が数件見られ、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>

5/17のGC T/N(5/18-5/19)は、▲0.08～▲0.07%程度の出合い。S/N(5/19-5/20)は、▲0.08～▲0.07%程度の出合い。引き続き売り物が比較的多い地合いとなっており、狭いレンジでの取引となった。SCは個別銘柄では10y336～342、30y49～50、40y8などにビッドが見られている。

<短国市場>

短国現先レートT/Nは、前日から横ばい圏のレート気配だった。短国アウトライト市場は、イベントが無く閑散で、カレントでは目立った出合いが見られなかった。

<CP市場>

CP市場は償還総額300億円程度に対し、20日発行分の前倒し案件もあり、発行総額は1,500億円程度となった。小売、電力等からのまとまった発行が見られた。発行レートは引き続き0%近辺が中心だったが、銘柄によってはやや高めのレートで決着するものもあった。

●短期金融市場関連指標

2016/5/17	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	▲ 0.058				－	▲ 0.081
T/N	▲ 0.065	0.000	▲ 0.062				－	▲ 0.077
S/N							－	－
1W	▲ 0.055	0.000	▲ 0.030				－	▲ 0.092
2W			0.000				－	▲ 0.099
3W							－	▲ 0.106
1M							－	▲ 0.112
3M							▲ 0.266	▲ 0.197
6M							▲ 0.407	▲ 0.208
1Y							▲ 0.295	▲ 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)
▲ 0.115	0.000	16,652.80	186.40	109.08-10	109.40-41

日付	5/10	5/11	5/12	5/13	5/16
日銀当預残	2,814,800	2,832,500	2,795,700	2,788,600	2,772,500
準備預金残	2,542,300	2,550,400	2,516,900	2,524,300	2,505,900
マネタリーベース	3,822,100	3,836,700	3,798,200	3,790,100	3,772,000
無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.065%	▲0.063%	▲0.055%	▲0.063%
コール市場残高	65,264	64,479	65,529	69,241	56,662
うち無担	51,749	52,426	51,878	52,514	40,600
うち有担	13,515	12,053	13,651	16,727	16,062

●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)
5年利付国債	127	0.10%	24,000	2016/5/19	2021/3/20	90,475.0	21,813.0	101.5700	▲0.2210%	3.5126%	101.5900	▲0.2250%	2,178.0
国有林野借入	－	－	552	2016/5/25	2021/5/25	2,207.0	552.00		0.0010%	50.0000%		0.0010%	

●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）	40,799	2016/5/17	2016/5/18		144	144		▲0.600	▲0.600	
米ドル資金供給		2016/5/19	2016/5/26	0.86	1	1				

●2016年5月18日の予定

*1-3月期のGDP1次速報　　*ユーロ圏4月の消費者物価指数改定値　　*国庫短期証券（608回）入札（1年、25,000億円、5/20発行）

◆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