Central Daily Market Report

2016年5月19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19日 需給速報		2016年5月20日 需給予想		2016年5月23日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 400		1,000	
財政	▲ 28,700		▲ 19,700		▲ 10,000	
資金過不足	▲ 28,900		▲ 20,100		▲ 9,000	
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					5,600	▲ 5,200
国債買現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,600			
CP等買入		▲ 200		▲ 700	4,000	
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	200		200		
当預増減	▲ 29,100		▲ 7,900		▲ 4,600	

当座預金残高	2,793,000	2,785,100	2,780,500
準備預金残高	2,521,400		
積み終了先	2,030,700		
超過準備	2,011,800		
非準備預金先	271,600		

5月20日以降の残り所要積立額	
積数	84,400
1日平均	3,100

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	96.04%	日数 12.90%

●2016年5月19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3兆1,000億円減の206兆9,000億円(当座預金残高見込みは279兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.045%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▲0.05～▲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%近辺の調整程度の出合いが見られつつ、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートターム物で▲0.04%近辺での出合いが散見された。共通担保資金供給オペは、2W物が8,000億円オファーされ、応札額は5,591億円(期落ち分2,270億円・2,880億円)の札割れとなった。

<レポ市場>

5/19のGC T/N(5/20-5/23)は、▲0.07～▲0.06%程度の出合い。S/N(5/23-5/24)は、▲0.06～▲0.05%程度の出合い。S/Nは短国3Mの発行要因から▲0.05%台までレート上昇となった。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、短国1Y物の発行要因から、前日比で小幅にレートが上昇した。短国3M物の入札は、WI取引で▲0.245～▲0.24%の小額の出合いが見られる中、結果は按分▲0.2405%、平均▲0.2489%、按分比率83.3779%と3M物として過去最低を更新した。セカンダリーでは▲0.275～▲0.26%の出合いが見られた。その他では、1Y物で▲0.373～▲0.355%の出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は償還総額1,200億円程度に対し、発行総額は400億円程度であった。商社からのまとまった発行案件が見られたが、案件数は少なく、閑散であった。発行レートは銘柄によるばらつきがあるものの、概ね0%近辺での発行となった。

●短期金融市場関連指標

2016/5/19	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				－	▲ 0.069
T/N	▲ 0.055	▲ 0.010	▲ 0.045				－	▲ 0.062
S/N							－	－
1W			▲ 0.045				－	▲ 0.085
2W			0.000				－	▲ 0.091
3W							－	▲ 0.102
1M							－	▲ 0.109
3M							▲ 0.260	▲ 0.197
6M							▲ 0.404	▲ 0.208
1Y							▲ 0.359	▲ 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)
▲ 0.080	0.025	16,646.66	1.97	110.17-19	110.07-09

日付		5/12	5/13	5/16	5/17	5/18
日銀当預残		2,795,700	2,788,600	2,772,500	2,818,700	2,822,100
準備預金残		2,516,900	2,524,300	2,505,900	2,555,600	2,552,300
マネタリーベース		3,798,200	3,790,100	3,772,000	3,816,700	3,819,500
無担O/N加重平均		▲0.063%	▲0.055%	▲0.063%	▲0.058%	▲0.059%
コール市場残高		65,529	69,241	56,662	60,193	59,954
	うち無担	51,878	52,514	40,600	45,456	43,059
	うち有担	13,651	16,727	16,062	14,737	16,895

●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)
国庫短期証券	609	－	43,500	2016/5/23	2016/8/22	206,048.0	39,544.3	100.0600	▲0.2405%	83.3779%	100.0621	▲0.2489%	3,955.0
20年利付国債	156	0.40%	11,000	2016/5/23	2036/3/20	33,624.0	9,999.0	101.9500	0.2950%	41.4215%	102.1000	0.2880%	994.0
交付税特会	－	－	10,500	2016/5/27	2016/11/28	62,958.0	10,500.09		0.0010%	16.6780%		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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2016/5/23	2016/6/6		5,591	5,591				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	10,000	2016/5/19	2016/5/20		148	148		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）	2,548	2016/5/19	2016/5/20		10	10		▲0.600	▲0.600	

●2016年5月20日の予定

*米国4月の中古住宅販売

◆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