Central Daily Market Report

2016年5月25日（水）

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25日 需給速報	2016年5月26日 需給予想	2016年5月27日 当社予想
銀行券	▲ 700	▲ 800	▲ 2,000
財政	500	7,600	2,000
資金過不足	▲ 200	6,800	0

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						
国債買入	5,300				12,000	
CP等買入		▲ 400		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200			1,000	
ＥＴＦ買入	300					
国債補完供給	▲ 100	100		100		
当預増減	4,800		6,800		13,000	

当座預金残高	2,830,600	2,837,400	2,850,400
準備預金残高	2,554,500		
積み終了先	2,096,900		
超過準備	2,096,100		
非準備預金先	276,100		

5月26日以降の残り所要積立額	
積数	22,000
1日平均	1,000

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	98.97%	日数	32.26%

●2016年5月25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1,000億円減の210兆3,000億円(当座預金残高見込みは283兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.04%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▲0.06～▲0.03%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後は、調整の出合いが見られる程度で、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートターム物で▲0.03%近辺での出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/N(5/26-5/27)は、▲0.090～▲0.085%程度の出合い。S/N(5/27-5/30)は、▲0.095～▲0.090%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は引き続き低水準で推移。アウトライト市場は材料が少なく、終日閑散で特段出合いもみられなかった。

<CP市場>

CP市場は機械、石油、商社業態等からまとまった発行案件が見られ、発行総額1,800億円程度に膨らんだ。発行レートは引き続き0%近辺であった。

●短期金融市場関連指標

2016/5/25	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	▲ 0.055				－	▲ 0.083
T/N			▲ 0.020				－	▲ 0.086
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	▲ 0.020	▲ 0.035				－	▲ 0.095
2W			0.001				－	▲ 0.099
3W			0.100				－	▲ 0.105
1M							－	▲ 0.117
3M							▲ 0.270	▲ 0.199
6M							▲ 0.337	▲ 0.209
1Y							▲ 0.362	▲ 0.215

JGB新発10年債	
直近値	前日比
▲ 0.101	0.009

日経平均株価	
15時時点	前日比
16,757.35	258.59

ドル/円	
為替(9時)	為替(17時)
110.16-17	110.02-04

日付	5/18	5/19	5/20	5/23	5/24
日銀当預残	2,822,100	2,793,000	2,785,400	2,783,600	2,825,800
準備預金残	2,552,300	2,521,400	2,514,100	2,514,500	2,550,600
マネタリーベース	3,819,500	3,790,600	3,783,300	3,781,100	3,823,900
無担O/N加重平均	▲0.059%	▲0.058%	▲0.053%	▲0.057%	▲0.055%
コール市場残高	59,954	62,116	64,725	59,359	63,113
うち無担	43,059	44,949	46,226	42,325	45,509
うち有担	16,895	17,167	18,499	17,034	17,604

●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)
交付税特会	－	－	10,500	2016/6/3	2016/12/2	57,899.0	10,500.01		0.0010%	18.1352%		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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	3,500	2016/5/27			16,005	3,505	0.003		0.005	4.0
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,400	2016/5/27			15,155	4,406	0.002		0.003	12.0
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,500	2016/5/27			18,006	4,507	0.004		0.005	27.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）	10,000	2016/5/25	2016/5/26		86	86		▲0.600	▲0.600	

●2016年5月26日の予定

*伊勢志摩サミット（27日まで）
*4月の企業向けサービス価格指数
*米国4月の耐久財新規受注
*米国1-3月期の英ＧＤＰ改定値
*国庫短期証券（610回）入札
（3ヶ月、44,000億円、5/30発行）
*40年利付国債入札
（4,000億円、5/30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