

Central Daily Market Report

2016年5月31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31日		2016年6月1日		2016年6月2日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	900		700		0	
財政	▲ 7,500		▲ 15,100		▲ 30,000	
資金過不足	▲ 6,600		▲ 14,400		▲ 30,000	
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	20,000					
国債買入	5,400		12,800			
CP等買入	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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 400	500		400		
当預増減	21,100		▲ 1,200		▲ 30,000	
当座預金残高	2,867,900		2,866,700		2,836,700	
準備預金残高	2,577,300					
積み終了先	2,128,800		6月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	2,128,800		積数		8,300	
非準備預金先	290,600		1日平均		600	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					2,129,200	
準備預金進捗率	実績	99.61%	日数	51.61%		

●2016年5月31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1兆7,000億円増の214兆円(当座預金残高見込みは286兆7,000億円)。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。月末要因でビッドが薄く、出合いのレンジは▲0.08~▲0.03%と前日に比べて低下した。一巡後は調整の出合いが散見される程度で、今月の取引を終えた。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(6/1-6/2)は、▲0.09~▲0.085%程度の出合い。S/N(6/2-6/3)は、▲0.085~▲0.08%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。短国市場は全般的に閑散な中、1Yが▲0.40~▲0.398%で少額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市場は入札件数・発行額共に少なく、発行総額は300億円程度と閑散。発行レートは概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2016/5/31	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.054				-	▲ 0.088	▲ 0.120	0.000	17,234.98	166.96	110.84-85	111.13-15
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.100						
2W							-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.144						
3M							▲ 0.284	▲ 0.202						
6M							▲ 0.307	▲ 0.215						
1Y							▲ 0.393	▲ 0.221						
									日付	5/24	5/25	5/26	5/27	5/30
									日銀当預残	2,825,800	2,830,600	2,837,000	2,849,100	2,846,800
									準備預金残	2,550,600	2,554,500	2,555,800	2,563,800	2,579,000
									マネタリーベース	3,823,900	3,829,500	3,836,800	3,850,000	3,847,100
									無担O/N加重平均	▲0.055%	▲0.055%	▲0.054%	▲0.049%	▲0.054%
									コール市場残高	63,113	64,091	68,083	72,789	65,615
									うち無担	45,509	47,423	50,895	55,314	49,372
									うち有担	17,604	16,668	17,188	17,475	16,243

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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)
2年利付国債	365	0.10%	23,000	2016/6/15	2018/6/15	115,400.0	20,915.0	100.6750	▲0.2350%	61.9341%	100.6780	▲0.2370%	2,076.0
預借借入(再生)	-	-	960	2016/6/10	2017/6/9	6,710.0	960.00		0.0000%	100.0000%		0.0000%	

●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)	10,000	2016/5/31	2016/6/1		254	254		▲0.600	▲0.600	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)	5,468	2016/5/31	2016/6/1		10	10		▲0.600	▲0.600	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数	
成長基盤強化	本則第24回	2016/6/3	2020/6/3	0	6,086	57
成長基盤強化	本則第12回(借り換え)	2016/6/3	2017/6/2	0	763	49
成長基盤強化	ABL等特別第20期	2016/6/6	2020/6/5	0	20	4
成長基盤強化	小口特別第17期	2016/6/3	2020/6/3	0	19.06	16
成長基盤強化	小口特別第5期(借り換え)	2016/6/3	2017/6/2	0	2.79	10
成長基盤強化	米ドル特別第16期	2016/6/3	2017/6/2		123	16
成長基盤強化	米ドル特別第12期(借り換え)	2016/6/3	2017/6/2		44	14
成長基盤強化	米ドル特別第8期(借り換え)	2016/6/3	2017/6/2		1,992	25
成長基盤強化	米ドル特別第4期(借り換え)	2016/6/3	2017/6/2		1,202	24

●2016年6月1日の予定

*1-3月期の法人企業統計調査季報	*米国4月の建設支出	*交付税特別会計借入
*米国ページブック	*米国5月のISM製造業景況指数	(10,500億円、6/10借入)

◆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