CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/8/17(月)　≪セントラル短資株式会社≫

≪資金需給≫

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想	19日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		900	700	0
財政		▲ 33,500	4,600	1,000
資金過不足		▲ 32,600	5,300	1,000
貸出				
売出手形 0				
本店共通 0				
全店共通 0				
共通(固定) 66,339		1,200 ▲ 1,300		
国債買現 0				
CP買現 0				
国庫短期証買入			15,000	
国庫短期証売却				
国債買入			12,100	
CP等買入		▲ 100	▲ 100	
貸出支援基金(成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援 3,241				
社債等買入			1,300	
ETF買入		200	100	
国債補完供給				
小計		0	28,400	0
当預増減		▲ 32,600	33,700	1,000

当座預金残高	2,264,400	8/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,062,600		737,600
積み終了先	1,573,500	8/18以降の残り所要積立額	
超過準備	1,242,500	積数	265,300
非準預先残高	201,800	1日平均	9,100
積み期間(8/16～9/15)の所要準備額(積数)			2,028,500

準備預金進捗率　86.92%　(実績)　6.45%　(日数)

8/14のマネタリーベース				3,253,600		
8/14コール	合計	206,357	無担	75,671	有担	130,686
コール前日増減	計	▲ 1,628	無担	▲ 1,850	有担	222

≪ 8/18の日銀調節とレート予想 ≫

日銀調節	見送り	当座預金残高	2,298,100	前日比	33,700
O／N	0.07～0.08	T／N	0.07～0.12	S／N	0.07～0.12

無担O/Nは0.07%台半ばでの出合いが中心になると予想される。

≪ 17日のインターバンク市場動向 ≫

午前8時発表の準備預金残高見込みは、171兆9,000億円(当座預金残高見込みは、226兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.073～0.076%、大手行からは0.074～0.075%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.075～0.076%となった。また一部業態が試し取りと見られる調達を行った。一巡後は徐々にビッドが薄くなり、0.07%近辺での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが散見される程度であった。

≪ 17日のオープン市場動向 ≫

現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、総じて閑散な地合いで、3Mで▲0.001%の出合いが見られた程度であった。CP市場は、500億円程度の償還に対し、850億円程度の発行となった。発行レートは概ね横ばい圏の決着となった。

≪ 18日の材料 ≫

*米国7月の住宅着工件数
*英国7月の消費者物価指数
*国庫短期証券入札(1年、25,000億円、8/20発行)
*20年利付国債入札(12,000億円、8/20発行)

≪コール7月積み期間分の加重平均レート≫

(土日を含む)	無担	0.07432%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07495%	有担	0.03100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	124.37-38
0.390	0.015	20,620.26	100.81	為替(5時)	124.50-51

O／N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移

日付	8/10	8/11	8/12	8/13	8/14	8/17
日銀当預残	2,199,900	2,209,300	2,234,600	2,221,100	2,297,000	2,264,400
準備預金残	2,000,000	2,006,300	2,036,400	2,025,200	2,093,800	2,062,600
レート	0.075%	0.076%	0.077%	0.075%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07350%	0.07373%	0.07400%	0.07408%	0.07444%	0.07459%

8/17 の加重平均レート(速報)					8/14 の加重平均レート(確報)		単位 (%)
無担 (平均)	有担 (平均)	CP気配a-1	短国		無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.060 ～0.125 (0.077)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N	0.060 ～0.125 (0.076)		0.030 ～0.040 (0.031)
0.073 ～0.120 (0.084)				T/N		0.073 ～0.120 (0.084)	
				S/N			
0.121 ～0.340 (0.131)				1W		0.064 ～0.117 (0.107)	
0.118 ～0.340 (0.127)				2W		0.118 ～0.310 (0.120)	
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.001	3M			
		-		6M			
		-	-	1Y			

≪オペ情報、入札結果≫

本日は日本銀行による調節はありませんでした。

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。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