

CENTRAL DAILY MARKET REPORT

2015/8/21(金) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	21日需給速報		24日需給予想	25日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲1,400	0	0
財政		1,900	▲9,600	1,000
資金過不足		500	▲9,600	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			2,700	
66,339			▲2,800	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				17,500
国庫短期証売却				
国債買入		8,300		12,000
CP等買入		3,500	▲300	
		▲200		
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				
ETF買入			100	
国債補完供給	即日	▲300		
		100	300	
小計		11,400	0	29,500
当預増減		11,900	▲9,600	30,500

当座預金残高	2,282,900	8/21以降の残り所要積立額	74,100
準備預金残高	2,076,900	8/24以降の残り所要積立額	27,500
積み終了先	1,718,100	積数	1,200
超過準備	1,714,400	1日平均	1,200
非準備先残高	206,000	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	98.64% (実績)		25.81% (日数)

8/20のマネタリーベース		3,226,900	
8/20コール合計	206,310	無担	77,106
有担	129,204		
コール前日増減	▲1,866	無担	47
有担	▲1,913		

8/21の加重平均レート(速報)				8/20の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.060 ~ 0.125 (0.077)	0.030 ~ 0.040 (0.031)	CP気配a-1	短国	O/N	0.060 ~ 0.125 (0.076)	無担先日付分	有担先日付分
0.071 ~ 0.120 (0.082)				T/N		0.071 ~ 0.120 (0.083)	
0.071 ~ 0.123 (0.110)				S/N		0.117 ~ 0.130 (0.118)	
				1W	0.117 (0.117)		
				2W			
				3W			
0.165 ~ 0.200 (0.178)		0.08-0.13	-	1M		0.200 ~ 0.280 (0.213)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.018	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	6,047億円	8/21	~	8/24 (3日間)	応札	150億円	落札	150億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債補完	4,000億円	8/21	~	8/24 (3日間)	応札	98億円	落札	98億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	17,500億円	8/25	応札	26,045億円	落札	17,500億円	按分利回り較差	0.009%	69.1%	平均利回り較差	0.010%	
国債買入	3,750億円	8/25	応札	17,687億円	落札	3,753億円	按分利回り較差	0.003%	36.9%	平均利回り較差	0.004%	
国債買入	4,250億円	8/25	応札	15,124億円	落札	4,252億円	按分利回り較差	0.004%	12.0%	平均利回り較差	0.006%	
国債買入	4,000億円	8/25	応札	10,221億円	落札	4,000億円	按分利回り較差	-0.001%	80.0%	平均利回り較差	0.001%	

ETF買入 337億円 約定日 8/21

J-REIT買入 13億円 約定日 8/21

「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。」

8/24の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,273,300	前日比	▲9,600
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。

<< 21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、173兆円(当座預金残高見込みは、228兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行、地銀、信託から0.076~0.077%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.077~0.078%と昨日よりも強めの立ち上がりとなった。一巡後はやや調達レートを切り下げ、まとまった金額に関しては0.07%台半ば、少額の取引では0.07%での出合いが数件見られる程度で、今週の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物を0.117%で調達を行った。

<< 21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、閑散とした地合いの中、3Mで▲0.018%の出合いが見られた程度であった。短国買入オペが1兆7,500億円でオファーされ、平均落札利回較差+0.010%、按分落札利回較差+0.009%の結果となるなど、引け値の低い特定銘柄を中心に落札されたと見られる結果となった。CP市場は、5・10日発行にあたったことで、鉄鋼業態等から大型発行案件が実施された。2,900億円程度の償還に対し、2,000億円程度の発行となった。発行レートは横ばい圏での決着となった。

<< 21日の材料 >>
*特にありません

JGB新発10年債	0.350	▲0.005	日経平均株価(終値)	19,435.83	▲597.69	為替(9時)	123.44-46
						為替(5時)	122.89-90

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	8/14	8/17	8/18	8/19	8/20	8/21
日銀当預残	2,297,000	2,264,400	2,297,900	2,301,200	2,271,000	2,282,900
準備預金残	2,093,800	2,062,600	2,093,500	2,093,500	2,061,400	2,076,900
レート	0.076%	0.077%	0.083%	0.077%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07444%	0.07459%	0.07506%	0.07516%	0.07520%	0.07543%

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