

2015/9/1(火)

《セントラル短資株式会社》

## 《資金需給》

単位 億円

|                                       | 1日需給速報    |               | 2日需給予想   | 3日当社予想 |
|---------------------------------------|-----------|---------------|----------|--------|
|                                       | 即日        | 金額            | 金額       | 金額     |
| 銀行券                                   |           | 1,300         | 600      | 0      |
| 財政                                    |           | ▲ 6,700       | ▲ 15,500 | 2,000  |
| 資金過不足                                 |           | ▲ 5,400       | ▲ 14,900 | 2,000  |
| 貸出                                    |           |               |          |        |
| 売出手形                                  |           |               |          |        |
| 0                                     |           |               |          |        |
| 本店共通                                  |           |               |          |        |
| 0                                     |           |               |          |        |
| 全店共通                                  |           |               |          |        |
| 0                                     |           |               |          |        |
| 共通(固定)                                |           | 8,500         |          |        |
| 64,973                                |           | ▲ 7,300       |          |        |
| 国債買現                                  |           |               |          |        |
| 0                                     |           |               |          |        |
| CP買現                                  |           |               |          |        |
| 0                                     |           |               |          |        |
| 国庫短期証買入                               |           | 8,000         |          |        |
| 国庫短期証売却                               |           |               |          |        |
| 国債買入                                  |           | 5,400         | 12,000   |        |
| CP等買入                                 |           | ▲ 100         | ▲ 100    |        |
| 貸出支援基金<br>(成長) 48,511<br>(増加) 244,836 |           |               |          |        |
| 被災地支援                                 |           |               |          |        |
| 3,166                                 |           |               |          |        |
| 社債等買入                                 |           |               | ▲ 100    |        |
| ETF買入                                 |           |               |          |        |
| 国債補完供給                                |           |               |          |        |
| 小計                                    |           | 14,500        | 11,800   | 0      |
| 当預増減                                  |           | 9,100         | ▲ 3,100  | 2,000  |
| 当座預金残高                                | 2,323,400 | 9/1以降の残り所要積立額 |          |        |
| 準備預金残高                                | 2,112,900 |               |          |        |
| 積み終了先                                 | 1,770,000 | 9/2以降の残り所要積立額 |          |        |
| 超過準備                                  | 1,770,000 | 積数            |          |        |
| 非準備先残高                                | 210,500   | 1日平均          |          |        |
| 積み期間(8/16～9/15)の所要準備額(積数)             | 2,022,700 |               |          |        |
| 準備預金進捗率                               | 99.74%    | (実績)          | 54.84%   | (日数)   |

|               |    |           |                      |
|---------------|----|-----------|----------------------|
| 8/31のマネタリーベース |    | 3,274,500 |                      |
| 8/31コール       | 合計 | 201,839   | 無担 63,310 有担 138,529 |
| コール前日増減       | 計  | ▲ 13,758  | 無担 ▲ 16,071 有担 2,313 |

| 9/1 の加重平均レート(速報)     |                      |           |    |     | 8/31 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                |        |
| 0.053 ～0.125 (0.076) | 0.030 ～0.040 (0.031) |           |    | O/N | 0.053 ～0.080 (0.071) |                      | 0.030 ～0.040 (0.031) |        |
| 0.073 ～0.120 (0.080) |                      |           |    | T/N |                      | 0.065 ～0.120 (0.080) |                      |        |
|                      |                      |           |    | S/N |                      |                      |                      |        |
| 0.125 ～0.140 (0.130) |                      |           |    | 1W  |                      |                      |                      |        |
| 0.118 ～0.170 (0.122) |                      |           |    | 2W  |                      | 0.118 ～0.340 (0.118) |                      |        |
|                      |                      |           |    | 3W  |                      |                      |                      |        |
|                      |                      | 0.08-0.13 | -  | 1M  |                      |                      | 有担先日付分               |        |
|                      |                      | 0.08-0.12 | -  | 2M  |                      |                      |                      |        |
|                      |                      | 0.08-0.12 | -  | 3M  |                      |                      |                      |        |
|                      |                      | -         | -  | 6M  |                      |                      |                      |        |
|                      |                      | -         | -  | 1Y  |                      |                      |                      |        |

## 《オペ情報、入札結果》

国債補完 11,432億円 9/1 ～ 9/2 (1日間) 応札 20億円 落札 20億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 9/3～9/11 (8日間) 応札なし 貸付利率 0.640%

10年利付国債(表面利率0.4%) 応札7兆6,536億円 落札2兆1,765億円(I 非競争入札:2,164億円) 9/24～2025/9/20 0.422% 按分49.6289% 平均0.421%

交付税特会 1兆500億円 9/9～2016/3/9 応札3兆3,540億円 落札1兆500億100万円 0.072% 按分60.6470% 平均0.071%

ETF買入 337億円 約定日 9/1

J-REIT買入 13億円 約定日 9/1

「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

| 《 9/2の日銀調節とレート予想 》              |           |        |           |     |           |
|---------------------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節                            | 見送り       | 当座預金残高 | 2,320,300 | 前日比 | ▲ 3,100   |
| O/N                             | 0.07～0.08 | T/N    | 0.07～0.12 | S/N | 0.07～0.12 |
| 無担O/Nは0.075%前後の出合いが中心になると予想される。 |           |        |           |     |           |

## 《 1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、前日比1兆5,000億円増の177兆2,000億円(当座預金残高見込みは232兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態から0.074～0.075%での調達が始まった。また、まとまった金額に対しては0.076～0.077%での調達も散見された。月末を通過した事でビッド水準が戻り、落ち着いた展開のなか本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。

## 《 1日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は動意に乏しく、特段出合いは見られなかった。CP市場は発行件数が少なく、発行総額は1,100億円程度となった。発行レートは概ね横ばいだった。

## 《 2日の材料 》

- \*8月のマネタリーベース
- \*9月の日銀当座預金増減要因見込み
- \*米国ページュブック
- \*米国7月の製造業新規受注・出荷・在庫

## 《コール8月の加重平均レート》

|         |    |          |    |          |
|---------|----|----------|----|----------|
| (土日を含む) | 無担 | 0.07555% | 有担 | 0.03100% |
| (営業日のみ) | 無担 | 0.07638% | 有担 | 0.03100% |

|           |       |            |          |        |           |
|-----------|-------|------------|----------|--------|-----------|
| JGB新発10年債 |       | 日経平均株価(終値) |          | 為替(9時) | 121.11-12 |
| 0.385     | 0.010 | 18,165.69  | ▲ 724.79 | 為替(5時) | 120.05-08 |

| 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                             | 8/25      | 8/26      | 8/27      | 8/28      | 8/31      | 9/1       |
| 日銀当預残                          | 2,309,400 | 2,310,600 | 2,307,400 | 2,315,900 | 2,314,300 | 2,323,400 |
| 準備預金残                          | 2,102,100 | 2,102,400 | 2,098,700 | 2,101,700 | 2,100,900 | 2,112,900 |
| レート                            | 0.076%    | 0.080%    | 0.076%    | 0.076%    | 0.071%    | 0.076%    |
| 月中平均                           | 0.07548%  | 0.07565%  | 0.07567%  | 0.07568%  | 0.07555%  | 0.07600%  |