

2015/9/7(月) <セントラル短資株式会社>

<資金需給>

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,600	1,000	1,000
財政		▲ 7,800	1,400	1,000
資金過不足		▲ 6,200	2,400	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		600	9,200	
65,853		▲ 700	▲ 7,200	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			6,000	
国庫短期証売却				
国債買入			4,900	12,000
CP等買入			5,000	
		▲ 200	▲ 500	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 244,836				
被災地支援				
3,166				
社債等買入				
ETF買入			400	
国債補完供給		300		
小計		0	17,800	12,000
当預増減		▲ 6,200	20,200	14,000

当座預金残高	2,326,200	9/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,119,200		2,400
積み終了先	1,775,300	9/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,775,300	積数	2,100
非準預先残高	207,000	1日平均	300
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	2,028,900		
準備預金進捗率	99.90%	(実績)	74.19% (日数)

9/4のマネタリーベース		3,290,500	
9/4コール 合計	199,654	無担	69,805
コール前日増減	計	▲ 4,944	無担 ▲ 3,101
			有担 ▲ 1,843

9/7 の加重平均レート(速報)				9/4 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 ~0.080 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)				O/N	0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.130 (0.085)						T/N		0.072 ~0.120 (0.082)	
0.125 (0.125)						S/N		0.125 (0.125)	
0.117 (0.117)						1W		0.117 (0.117)	
						2W			
						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	4,000億円	9/7	~	9/8 (1日間)	応札	10億円	落札	10億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	9/9	応札	15,962億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.007%	46.8%	平均利回り較差	0.008%	
国債買入	4,000億円	9/9	応札	17,480億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	0.003%	64.6%	平均利回り較差	0.003%	
国債買入	4,000億円	9/9	応札	19,327億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.003%	54.8%	平均利回り較差	0.004%	

ETF買入 317億円 約定日 9/7

J-REIT買入 13億円 約定日 9/7

「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

< 9/8の日銀調節とレート予想 >					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,346,400	前日比	20,200
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。					

< 7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、前営業日比9,000億円減の177兆3,000億円(当座預金残高見込みは232兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託・系統業態から0.073~0.075%での調達が始まった。週末要因の剥落により、出合い水準はやや低下したものの、まとまった金額に対して0.075~0.077%での調達が複数散見された。ターム物は、大手行から1W物0.117%での調達が行われた。

< 7日のオープン市場動向 >

現先レートS/Nは同水準で推移した。短国市場は、材料に乏しく取引閑散だった。一方、CP市場は、石油業態からまとまった発行が見られ、発行総額は900億円弱まで膨らんだ。発行レートは、全体的に小幅低下した。

< 8日の材料 >

*4-6月期のGDP 2次速報(市場予想：前期比年率▲1.8%)

*7月の国際収支

*7月の特定サービス産業動態統計速報

*8月の景気ウォッチャー調査

*米国7月の消費者信用残高

*米国8月のFRB労働市場情勢指数

*ユーロ圏4-6月期のGDP改定値

*国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、9/10発行)

*30年利付国債入札(8,000億円、9/24発行)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	119.14-15
0.365	0.000	為替(5時)	119.29-31
	17,860.47		68.31

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	8/31	9/1	9/2	9/3	9/4	9/7
日銀当預残	2,314,300	2,323,400	2,320,000	2,314,900	2,332,400	2,326,200
準備預金残	2,100,900	2,112,900	2,110,000	2,104,400	2,123,300	2,119,200
レート	0.071%	0.076%	0.077%	0.077%	0.076%	0.075%
月中平均	0.07555%	0.07600%	0.07650%	0.07667%	0.07633%	0.07614%