

2015/9/14(月) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	14日需給速報	15日需給予想	16日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	500	▲ 900	0
財政	▲ 8,300	▲ 100	▲ 1,000
資金過不足	▲ 7,800	▲ 1,000	▲ 1,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)			
62,533			
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		8,700	
CP等買入			
	▲ 300	▲ 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		1,000	
ETF買入		200	
国債補完供給			
小計	▲ 300	24,400	0
当預増減	▲ 8,100	23,400	▲ 1,000

当座預金残高	2,333,800	9/14以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,133,700		100
積み終了先	1,789,800	9/15以降の残り所要積立額	
超過準備	1,789,800	積数	0
非準備先残高	200,100	1日平均	0
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	100.00% (実績)	96.77% (日数)	

9/11のマナタリーベース	3,297,700
9/11コール 合計	203,153 無担 70,260 有担 132,893
コール前日増減 計	1,491 無担 ▲ 257 有担 1,748

9/14 の加重平均レート(速報)				9/11 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	
0.030 ～0.122 (0.076)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N	0.030 ～0.125 (0.076)		0.030 ～0.040 (0.031)	
0.030 ～0.120 (0.075)				T/N		0.030 ～0.120 (0.070)		
0.130 (0.130)				S/N				
0.081 (0.081)				1W				
0.076 ～0.340 (0.080)				2W	0.200 (0.200)	0.310 (0.310)		
				3W				
0.150 (0.150)		0.08-0.13	-	1M		0.075 (0.075)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.015-▲0.01	3M				
		-	▲0.01	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,000億円	9/14	～	9/15 (1日間) 応札	1億円	落札	1億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
CP買入	5,000億円	9/17	応札	8,124億円	落札	4,991億円	按分レート	0.058%	78.6%	平均落札レート	0.075%

「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

<< 9/15の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,357,200	前日比	23,400
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。					

<< 14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2,000億円減の179兆2,000億円(当座預金残高見込みは233兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態から0.074～0.077%での調達で始まった。一巡後は、0.072～0.077%での出合いが散見され本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が複数見られた。

<< 14日のオープン市場動向 >>

短国現先レート、S/Nは前日から小幅上昇。短国アウトライト市場は買いが強く、3Mが▲0.015～▲0.01%、6Mが▲0.01%の出合いが見られた。C P市場は償還総額1,400億円程度に対し、一部大型の発行案件が見られたものの、発行総額は700億円程度にとどまった。発行レートは、9月末越え期日物で小幅に低下する動きが見られた。C P等買入オベが5,000億円通知され、按分レート0.058%、平均レート0.075%と、前回(按分0.075%、平均0.083%)よりもレートが共に低下した。

<< 15日の材料 >>

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- *黒田日銀総裁、定例会見
- *米国7月の企業在庫
- *米国8月の小売売上高
- *米国8月の鉱工業生産・設備稼働率
- *英国8月の英消費者物価指数

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.80-82
0.355	0.010	為替(5時)	120.15-17

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	9/7	9/8	9/9	9/10	9/11	9/14
日銀当預残	2,326,200	2,346,600	2,363,600	2,339,100	2,341,900	2,333,800
準備預金残	2,119,200	2,137,900	2,155,000	2,132,700	2,136,200	2,133,700
レート	0.075%	0.075%	0.075%	0.076%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07614%	0.07600%	0.07589%	0.07590%	0.07592%	0.07593%

9/14 の加重平均レート(速報)				9/11 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	
0.030 ～0.122 (0.076)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N	0.030 ～0.125 (0.076)		0.030 ～0.040 (0.031)	
0.030 ～0.120 (0.075)				T/N		0.030 ～0.120 (0.070)		
0.130 (0.130)				S/N				
0.081 (0.081)				1W				
0.076 ～0.340 (0.080)				2W	0.200 (0.200)	0.310 (0.310)		
				3W				
0.150 (0.150)		0.08-0.13	-	1M		0.075 (0.075)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.015-▲0.01	3M				
		-	▲0.01	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,000億円	9/14	～	9/15 (1日間) 応札	1億円	落札	1億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
CP買入	5,000億円	9/17	応札	8,124億円	落札	4,991億円	按分レート	0.058%	78.6%	平均落札レート	0.075%

「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