

2015/9/16(水)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	16日需給速報	17日需給予想	18日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 1,700	▲ 3,700	▲ 2,000
財政	▲ 500	▲ 600	1,000
資金過不足	▲ 2,200	▲ 4,300	▲ 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			
国庫短期証売却			
国債買入			
CP等買入		5,000	
	▲ 400	▲ 300	
貸出支援基金		7,300	
(成長) 51,505			
(増加) 244,836		▲ 2,300	
被災地支援			
3,166			
社債等買入		▲ 100	
ETF買入	300		
国債補完供給			
小計	▲ 100	9,600	0
当預増減	▲ 2,300	5,300	▲ 1,000

当座預金残高	2,353,900	9/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,152,600		1,952,800
積み終了先	655,600	9/17以降の残り所要積立額	
超過準備	520,300	積数	671,300
非準備先残高	201,300	1日平均	23,100
積み期間(9/16～10/15)の所要準備額(積数)			1,952,800
準備預金進捗率	65.62%	(実績)	3.33% (日数)

9/15のマネタリーベース	3,312,800
9/15コール 合計	188,110 無担 53,602 有担 134,508
コール前日増減 計	▲ 14,402 無担 ▲ 13,658 有担 ▲ 744

9/16 の加重平均レート(速報)				9/15 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	有担先日付分	
0.060 ～0.125 (0.091)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N 0.005 ～0.125 (0.076)		0.030 ～0.040 (0.031)		
0.072 ～0.121 (0.080)				T/N	0.030 ～0.120 (0.076)			
				S/N				
0.068 ～0.205 (0.100)				1W	0.077 ～0.117 (0.087)			
0.118 ～0.120 (0.118)				2W	0.075 ～0.170 (0.118)			
				3W				
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	-	3M				
		-	▲0.02	6M				
		-	▲0.07-▲0.03	1Y				

《オペ情報、入札結果》

被災地支援(第53回) 9/25～2016/9/23 (364日間) 貸付予定総額 975億円 貸付利率 0.10%

T-Bill1Y 応札9兆2,473億円 落札2兆2,865億6,000万円(非競争入札:2,134億円) 9/24～2016/9/20 ▲0.0161% 按分97.7954% 平均▲0.0252%

20年利付国債(表面利率1.2%) 応札2兆7,908億円 落札1兆918億円(I 非競争入札:1,076億円) 9/24～2035/9/20 1.181% 按分83.9388% 平均1.164%

「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。」

9/17の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,359,200	前日比	5,300
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。

《 16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6,000億円減の179兆8,000億円(当座預金残高見込みは235兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・系統・証券業態から0.074～0.077%での調達で始まった。一巡後、複数の取り手によるストレスチェックの動きがあり、0.125%でまとまった出合いが見られた。その他は、0.07～0.075%程度を中心に、散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

《 16日のオープン市場動向 》

短国現先レート、S/Nは前日から横ばい圏で推移した。短国1Y物の入札は、按分落札レート▲0.0161%(按分比率97.7954%)、平均落札レート▲0.0252%と堅調な結果で、セカンダリーでは▲0.07～▲0.03%の出合いだった。また、6M物で▲0.02%の出合いが見られた。CP市場は償還総額2,600億円程度に対し、鉄鋼・ノンバンク業態からのまとまった発行案件が見られ、発行総額は3,100億円程度となった。発行レートは低位横ばい圏で推移し、9月末越えの期日物では一段と低下する動きが見られた。

《 17日の材料 》

*8月の貿易統計

*黒田日銀総裁、全国証券大会にて講演

*米国FOMC(2日目)

*米国F R B経済見通し発表

*米国8月の住宅着工件数

*国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、9/24発行)

《コール8月積み期間分の加重平均レート》

(土日を含む)	無担	0.07632%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07636%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.41-43
0.365 ▲ 0.005	18,171.60 145.12	為替(5時)	120.24-26

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	9/9	9/10	9/11	9/14	9/15	9/16
日銀当預残	2,363,600	2,339,100	2,341,900	2,333,800	2,356,200	2,353,900
準備預金残	2,155,000	2,132,700	2,136,200	2,133,700	2,152,000	2,152,600
レート	0.075%	0.076%	0.076%	0.076%	0.076%	0.091%
月中平均	0.07589%	0.07590%	0.07592%	0.07593%	0.07593%	0.07688%

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