

2015/10/19(月) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想	21日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 700	0
財政		1,100	▲ 15,600	1,000
資金過不足		1,000	▲ 16,300	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,000		
65,632		▲ 1,000		
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		12,000		12,000
CP等買入		▲ 100	▲ 500	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028				
被災地支援		3,166		
社債等買入			1,300	
			▲ 100	
ETF買入				100
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		12,800	900	27,000
当増減		13,800	▲ 15,400	28,000

<<10/20の日銀調節とレート予想>>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,416,300	前日比	▲ 15,400
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.07~0.08%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

<<19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2兆円増の182兆3,000億円(当座預金残高見込みは243兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態を中心に0.075~0.076%近辺の調達希望で始まった。週末要因が剥落し、立ち上がりは0.075~0.077%での出合いであった。一巡後は0.07%近辺での出合いで本日の取引を終えた。ターム物は目立った出合は見られなかった。

<<19日のオープン市場動向>>
 現先レートは横ばい圏で推移した。短国アウトライツ市場では、短国買入オペが15,000億円度でオフアされた。落札結果は、引け値が低い銘柄を中心に応札されたとみられ、平均利回り較差+0.013% 按分利回り較差+0.008% 按分率89.5%となった。CP市場はCP等買入オペが4,000億円度でオフアされた。今月に入ってからの発行残高増加の足取りが鈍く、落札結果は平均落札利回り0.076% 按分利回り0.068%と小幅上昇にとどまった。発行市場は、案件に乏しく、横ばい圏での動きとなった。

<<20日の材料>>
 *米国9月の住宅着工件数
 *20年利付国債入札(12,000億円、10/22発行)

<<コール9月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07457%	有担 0.03090%
(営業日のみ)	無担	0.07339%	有担 0.03083%

当座預金残高	2,431,700	10/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,211,200		130,800
積み終了先	1,784,300	10/20以降の残り所要積立額	
超過準備	1,765,700	積数	86,700
非準備先残高	220,500	1日平均	3,200
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			2,019,500
準備預金進捗率	95.71%	(実績)	12.90% (日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	119.30-32
0.320	0.005		
	18,131.23	為替(5時)	119.33-35
	▲ 160.57		

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	10/9	10/13	10/14	10/15	10/16	10/19
日銀当預残	2,410,300	2,355,100	2,388,900	2,442,600	2,417,900	2,431,700
準備預金残	2,190,100	2,141,400	2,166,300	2,217,500	2,199,000	2,211,200
レート	0.075%	0.076%	0.076%	0.076%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07592%	0.07592%	0.07593%	0.07593%	0.07611%	0.07611%

10/19の加重平均レート(速報)				10/16の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)	有担(平均)	CP配a-1	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分		
0.060 ~ 0.130 (0.076)	0.030 ~ 0.040 (0.031)			0.065 ~ 0.125 (0.077)		0.030 ~ 0.040 (0.031)		
0.070 ~ 0.121 (0.080)					0.070 ~ 0.121 (0.080)			
0.099 (0.099)								
0.340 (0.340)								
		0.07-0.12	-	1M	0.140 ~ 0.280 (0.163)	有担先日付分		
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	-	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,343億円	10/19	~ 10/20 (1日間) 応札	100億円	落札	100億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	15,000億円	10/21	応札	34,466億円	落札	15,002億円	按分利回り較差	89.5%	平均利回り較差	0.013%
国債買入	4,000億円	10/21	応札	14,837億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	20.3%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,000億円	10/21	応札	11,493億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	11.0%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,000億円	10/21	応札	19,890億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	23.3%	平均利回り較差	0.009%
CP買入	4,000億円	10/22	応札	6,486億円	落札	4,000億円	全取レート	0.068%	平均落札レート	0.076%

被災地支援(第54回) 10/23~2016/10/21 (364日間) 貸付予定総額 70億円 貸付利率 0.10%

「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録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