

2015/8/12(水) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	12日需給速報 即日 金額	13日需給予想 金額	14日当社予想 金額
銀行券	▲ 600	▲ 1,300	▲ 1,000
財政	▲ 3,600	▲ 8,900	72,000
資金過不足	▲ 4,200	▲ 10,200	71,000
貸出			
売出手形 0			
本店共通 0			
全店共通 0			
共通(固定) 66,430			
国債買現 0			
CP買現 0			
国庫短期証買入	17,500		
国庫短期証売却			
国債買入	12,200		4,500
CP等買入	▲ 500	▲ 800	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836			
被災地支援 3,241			
社債等買入			
ETF買入		100	
国債補完供給	300		
小計	29,500	▲ 700	4,500
当預増減	25,300	▲ 10,900	75,500

当座預金残高	2,234,600	8/12以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,036,400		600
積み終了先	1,711,200	8/13以降の残り所要積立額	
超過準備	1,711,200	積数	300
非準預先残高	198,200	1日平均	100
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	2,028,200		
準備預金進捗率	99.99% (実績)	90.32% (日数)	

8/11のマネタリーベース	3,163,200
8/11コール 合計	204,025 無担 73,460 有担 130,565
コール前日増減 計	▲ 1,075 無担 ▲ 570 有担 ▲ 505

8/12 の加重平均レート(速報)					
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国		
0.055 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.055 ~0.125 (0.076)
0.073 ~0.120 (0.085)				T/N	
				S/N	
0.052 ~0.130 (0.086)				1W	0.130 (0.130)
0.116 (0.116)				2W	0.114 ~0.170 (0.118)
				3W	
		0.08-0.13	-	1M	0.075 ~0.130 (0.097)
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12		3M	
		-	▲0.085-▲0.082	6M	
		-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	700億円	8/14	応札	2,035億円 落札	700億円	按分利回り較差	-0.001%	39.1%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	2,400億円	8/14	応札	7,140億円 落札	2,401億円	按分利回り較差	-0.030%	83.5%	平均利回り較差	-0.024%
国債買入	1,400億円	8/14	応札	4,155億円 落札	1,404億円	按分利回り較差	-0.027%	64.4%	平均利回り較差	-0.021%
社債買入	1,250億円	8/18	応札	2,570億円 落札	1,251億円	按分レート	0.061%	85.5%	平均落札レート	0.092%
ETF買入	337億円	約定日 8/12								
J-REIT買入	13億円	約定日 8/12								

「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

8/13の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,223,700	前日比	▲ 10,900
O/N	0.065~0.075	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.065~0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

<< 12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2兆1,000億円増加の170兆9,000億円(当座預金残高見込みは223兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託・証券より0.07%台前半の調達希望で始まり、立ち上がりは0.075%を挟んだ出合いが中心となった。一巡後は0.07%近辺の出合いが中心であったが、まとまった金額の取引に関しては0.075%を上回る出合いも散見された。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<< 12日のオープン市場動向 >>

現先S/N物は横ばい圏での推移となった。短国市場は6M物で▲0.085~▲0.082%で小額の出合いが見られた程度で、引き続き閑散であった。CP市場は償還総額1,000億円程度に対し、発行額は700億円程度にとどまった。発行レートは横ばいでの推移となった。

<< 13日の材料 >>

- *6月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲5.6%)
- *6月のマネタリーサーベイ
- *米国6月の企業在庫
- *米国7月の小売売上高
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、8/17発行)
- *5年利付国債入札(25,000億円、8/17発行)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	125.08-10
0.355	▲ 0.040	20,392.77	▲ 327.98	為替(5時)	124.47-49

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	8/5	8/6	8/7	8/10	8/11	8/12
日銀当預残	2,243,500	2,216,500	2,229,700	2,199,900	2,209,300	2,234,600
準備預金残	2,039,900	2,016,400	2,028,200	2,000,000	2,006,300	2,036,400
レート	0.078%	0.076%	0.076%	0.075%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07120%	0.07200%	0.07333%	0.07350%	0.07373%	0.07400%

8/12 の加重平均レート(速報)				8/11 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			
0.055 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.055 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.073 ~0.120 (0.085)				T/N		0.073 ~0.120 (0.081)			
				S/N					
0.052 ~0.130 (0.086)				1W		0.130 (0.130)			
0.116 (0.116)				2W		0.114 ~0.170 (0.118)			
				3W					
		0.08-0.13	-	1M		0.075 ~0.130 (0.097)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12		3M					
		-	▲0.085-▲0.082	6M					
		-	-	1Y					