

2015/8/31(月) <<セントラル短資株式会社>>

<<資金需給>>

単位 億円

	31日需給速報 即日 金額	1日需給予想 金額	2日当社予想 金額
銀行券	800	1,300	1,000
財政	▲ 3,000	▲ 6,600	▲ 8,000
資金過不足	▲ 2,200	▲ 5,300	▲ 7,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)	1,600	8,500	
63,779	▲ 2,100	▲ 7,300	
国債買現			
0			
CP買現			
0			
国庫短期証買入		8,000	
国庫短期証売却			
国債買入		5,400	11,800
CP等買入	3,500		
	▲ 2,900	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836			
被災地支援			
3,166			
社債等買入			
ETF買入	400		
国債補充供給	100		
小計	600	14,500	11,800
当増減	▲ 1,600	9,200	4,800
当座預金残高	2,314,300	8/31以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,100,900		6,600
積み終了先	1,757,900	9/1以降の残り所要積立額	
超過準備	1,757,900	積数	5,700
非準備先残高	213,400	1日平均	400
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)			2,022,700
準備預金進捗率	99.72%	(実績)	51.61% (日数)

8/28のマナタリーベース		3,276,900	
8/28コール 合計	215,597	無担	79,381
コール前日増減	計	6,692	無担 ▲ 56
			有担 6,748

8/31の加重平均レート(速報)				8/28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			
0.053 ~0.080 (0.071)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.050 ~0.080 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			
0.065 ~0.120 (0.080)				T/N					
				S/N	0.070 ~0.121 (0.083)				
				1W	0.117 ~0.130 (0.123)				
0.118 ~0.340 (0.119)				2W	0.310 (0.310)				
				3W					
		0.08-0.13	-	1M		有担先日付分			
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12	▲0.0015-▲0.001	3M					
		-	-	6M					
		-	-	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	8,000億円	8/31	~	9/1 (1日間)	応札	8億円	落札	8億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	3,750億円	9/2	応札	15,073億円	落札	3,754億円	按分利回り較差	0.005%	56.0%	平均利回り較差	0.005%	
国債買入	4,250億円	9/2	応札	15,586億円	落札	4,255億円	按分利回り較差	-0.002%	29.9%	平均利回り較差	0.000%	
国債買入	2,400億円	9/2	応札	8,257億円	落札	2,406億円	按分利回り較差	-0.010%	69.3%	平均利回り較差	-0.008%	
国債買入	1,400億円	9/2	応札	5,994億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	-0.010%	10.3%	平均利回り較差	-0.009%	
ETF買入	337億円	約定日	8/31									

成長基盤強化(本則第21回) 9/4~2019/9/3 (1,460日間) 貸付予定総額 5,489億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 57先
 成長基盤強化(本則第13回の借り換え) 9/4~2016/9/2 (364日間) 貸付予定総額 568億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 48先
 成長基盤強化(本則第9回の借り換え) 9/4~2016/9/2 (364日間) 貸付予定総額 629億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 40先
 成長基盤強化(ABL等特則第17期) 9/4~2019/9/4 (1,461日間) 貸付予定総額 78億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 6先
 成長基盤強化(ABL等特則第9期の借り換え) 9/4~2017/9/4 (731日間) 貸付予定総額 11億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 2先
 成長基盤強化(小口特則第14期) 9/4~2019/9/3 (1,460日間) 貸付予定総額 10.08億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 18先
 成長基盤強化(小口特則第6期の借り換え) 9/4~2016/9/2 (364日間) 貸付予定総額 1.34億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 7先
 成長基盤強化(小口特則第2期の借り換え) 9/4~2016/9/2 (364日間) 貸付予定総額 1.69億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 6先
 成長基盤強化(米ドル特則第13期) 9/4~2016/9/2 (364日間) 貸付予定総額 14百万ドル 貸付先数 14先
 成長基盤強化(米ドル特則第9期の借り換え) 9/4~2016/9/2 (364日間) 貸付予定総額 1,562百万ドル 貸付先数 35先
 成長基盤強化(米ドル特則第5期の借り換え) 9/4~2016/9/2 (364日間) 貸付予定総額 1,366百万ドル 貸付先数 20先
 成長基盤強化(米ドル特則第1期の借り換え) 10/16~2016/10/14 (364日間) 貸付予定総額 694百万ドル 貸付先数 5先

<< 9/1の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,323,500	前日比	9,200
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.07%台半ばでの出合いが中心になると予想される。					

<< 31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、175兆7,000億円(当座預金残高見込みは、231兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行、地銀、信託から0.065~0.07%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.07%と弱めの立ち上がりとなった。一巡後は、一部で0.07%台半ばの取引が見られたが、その後は0.065~0.07%の出合いが散見される程度で今月の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が2W物を0.118%で調達を行った。

<< 31日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は3M物で▲0.0015~▲0.001%の出合いが散見された程度であった。CP市場は商社・石油業態からの大型発行案件が見られたものの、発行件数が少なく、発行総額は700億円程度であった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となり、引き続き期越え物では運用ニーズの高まりが見られた。

<< 1日の材料 >>

- *4-6月期の法人企業統計調査季報
- *8月実績/9月見込み財政資金対民間収支
- *米国7月の建設支出 *米国8月のISM製造業景況指数
- *10年利付国債入札(24,000億円、9/24発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、9/9借入)

<<コール8月の加重平均レート>>

(土日を含む)	無担	0.07555%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07638%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	121.29-31
0.375 ▲ 0.005	18,890.48 ▲ 245.84	為替(5時)	121.18-20

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	8/24	8/25	8/26	8/27	8/28	8/31
日銀当預残	2,272,900	2,309,400	2,310,600	2,307,400	2,315,900	2,314,300
準備預金残	2,071,400	2,102,100	2,102,400	2,098,700	2,101,700	2,100,900
レート	0.076%	0.076%	0.080%	0.076%	0.076%	0.071%
月中平均	0.07546%	0.07548%	0.07565%	0.07567%	0.07568%	0.07555%

「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