

◀資金需給▶

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想		19日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,200	▲ 800	▲ 2,000		
財政		▲ 200	▲ 400	1,000		
資金過不足		1,000	▲ 1,200	▲ 1,000		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		97,081				
国債買現		0				
CP買現		0				
国庫短期証買入		2,500				
国庫短期証売却						
国債買入						
CP等買入		▲ 400	▲ 200			
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053		25,900				
被災地支援		▲ 300				
3,522						
社債等買入		1,500				
ETF買入						
国債補完供給	即日	200	100			
		▲ 100				
小計		29,300	▲ 100	0		
当増減		30,300	▲ 1,300	▲ 1,000		

当座預金残高	1,534,400	9/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,405,100		974,700
積み終了先	945,700	9/18以降の残り所要積立額	
超過準備	649,400	積数	418,600
非準預先残高	129,300	1日平均	14,900
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,844,100		
準備預金進捗率	77.30%	(実績)	6.67% (日数)

9/16のマナターベース		2,410,900	
9/16コール合計	163,898	無担	62,784
		有担	101,114
コール前日増減	計	3,653	無担
		2,636	有担
			1,017

9/17の加重平均レート(速報)				9/16の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.055 ~0.125 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)	CP気配a-1	短国	O/N	0.050 ~0.125 (0.067)	無担先日付分	有担当日分
0.060 ~0.120 (0.070)				T/N		0.065 ~0.120 (0.076)	
				S/N			
0.110 ~0.150 (0.126)				1W		0.117 ~0.280 (0.123)	
				2W		0.130 (0.130)	
				3W			
0.118 ~0.235 (0.123)		0.08-0.12	-	1M		0.075 ~0.340 (0.111)	有担先日付分
0.119 (0.119)		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.015-▲0.02	3M			
		-	▲0.02	6M			
		-	▲0.002-▲0.005	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	3,324億円	9/17 ~ 9/18 (1日間)	応札	83億円	落札	83億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
CP買入	5,500億円	9/22	応札	9,951億円	落札	5,431億円	按分レート	0.079%	47.5%	平均落札レート	0.087%
T-Bill1Y	応札12兆2,718億円	落札2兆3,188億8,000万円 (非競争入札:1,811億円)	9/22~2015/9/24	0.0059%	按分	73.1838%	平均	0.0019%			
20年利付国債(表面利率1.4%)	応札4兆2,506億円	落札1兆922億円 (I非競争入札:1,066億円)	9/22~2034/9/20	1.438%	按分	39.8793%	平均	1.435%			

◀ 9/18の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,533,100	前日比	▲ 1,300
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心になると見られる。

◀ 17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3兆3,000億円増の120兆7,000億円(当座預金残高見込みは153兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.063~0.065%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。一巡後は、散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。なお、一部邦銀から0.125%の試し取りと見られる調達があった。ターム物は、大手行から2W物と1M物で0.118%のまとまった調達が見られた。

◀ 17日のオープン市場動向 ▶
 短国現先のレートは前日横ばい圏であった。短国アウトライイト市場は、1Y物の入札が実施され、平均落札利回り0.0019%、按分落札利回り0.0059%、按分比率73.1838%という結果になった。タイトな需給環境から入札も堅調で、セカンダリーはマイナス圏の出合いが散見された。CP市場は償還総額1,900億円程度に対し、発行総額は2,300億円程度となった。五・十日にあたる発行となることから、発行は多目であったが、発行レートは横ばいからやや低下との印象であった。

- ◀ 18日の材料 ▶
- *黒田日銀総裁、全国証券大会にて講演
 - *8月の貿易統計
 - *米国8月の住宅着工件数
 - *ECB定例理事会(2日目、金融政策発表なし)
 - *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、9/22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	0.06923%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06920%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.555	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	15,888.67	▲ 22.86	為替(9時)	107.15-15
						為替(5時)	107.26-28

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	9/12	9/16	9/17
日銀当預残	1,519,600	1,509,300	1,518,800	1,521,300	1,504,100	1,534,400
準備預金残	1,388,200	1,374,100	1,386,500	1,390,800	1,374,600	1,405,100
レート	0.067%	0.071%	0.067%	0.070%	0.067%	0.066%
月中平均	0.06944%	0.06960%	0.06936%	0.06953%	0.06938%	0.06918%

「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