

2014/9/19(金)

《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 | | 22日需給予想 | 24日当社予想 |
|---------------------------------------|---------|---------|---------|---------|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | ▲ 1,000 | ▲ 400 | 0 |
| 財政 | | ▲ 700 | 57,800 | 0 |
| 資金過不足 | | ▲ 1,700 | 57,400 | 0 |
| 貸出 | | | | |
| 売出手形 | | | | |
| 0 | | | | |
| 本店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 全店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 共通(固定) | | | 2,500 | |
| 97,081 | | | ▲ 1,600 | |
| 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 | | | 11,900 | 6,100 |
| CP等買入 | | | 5,400 | |
| | | ▲ 700 | ▲ 400 | |
| 貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053 | | | | |
| 被災地支援 | | | | |
| 3,522 | | | | |
| 社債等買入 | | ▲ 800 | ▲ 100 | |
| ETF買入 | | | | |
| 国債補完供給 | | | | |
| 小計 | | ▲ 1,500 | 17,700 | 23,600 |
| 当預増減 | | ▲ 3,200 | 75,100 | 23,600 |

| | | | |
|---------|-------------|----------------------------|-------------|
| 当座預金残高 | 1,530,400 | 9/19以降の残り所要積立額 | 274,800 |
| 準備預金残高 | 1,399,800 | 9/22以降の残り所要積立額 | 145,200 |
| 積み終了先 | 1,174,700 | 積数 | 145,200 |
| 超過準備 | 1,158,900 | 1日平均 | 6,000 |
| 非準備先残高 | 130,600 | 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 | 92.13% (実績) | | 20.00% (日数) |

| 9/18のマナタリーベース | | 2,439,800 | |
|---------------|--------------|------------|---------|
| 9/18コール 合計 | 161,704 無担 | 61,387 有担 | 100,317 |
| コール前日増減 | 計 ▲ 1,906 無担 | ▲ 2,152 有担 | 246 |

| 9/19の加重平均レート(速報) | | | | 9/18の加重平均レート(確報) | | | | 単位 (%) |
|----------------------|----------------------|-----------|-------------|------------------|----------------------|----------------------|----------------------|--------|
| 無担(平均) | | 有担(平均) | | 無担当日分 | | 無担先日付分 | | 有担当日分 |
| 0.060 ~0.135 (0.069) | 0.030 ~0.040 (0.031) | CP気配a-1 | 短国 | O/N | 0.055 ~0.135 (0.068) | 0.060 ~0.120 (0.070) | 0.030 ~0.040 (0.031) | |
| 0.061 ~0.120 (0.092) | | | | T/N | | | | |
| 0.110 ~0.121 (0.117) | | | | S/N | | | | |
| 0.071 ~0.400 (0.132) | | | | 1W | 0.117 (0.117) | 0.115 ~0.117 (0.117) | | |
| 0.270 (0.270) | | | | 2W | | 0.117 (0.117) | | |
| | | | | 3W | | | | |
| 0.075 ~0.118 (0.107) | | 0.08-0.12 | - | 1M | | 0.118 ~0.165 (0.121) | 有担先日付分 | |
| | | 0.08-0.12 | - | 2M | | | | |
| | | 0.08-0.12 | ▲0.003-0.00 | 3M | | | | |
| | | - | - | 6M | | | | |
| | | - | ▲0.001 | 1Y | | | | |

《オペ情報、入札結果》

| | | | | | | | | | | | |
|------|----------|------|----|----------|----|----------|---------|---------|-------|---------|---------|
| 国短買入 | 17,500億円 | 9/24 | 応札 | 24,609億円 | 落札 | 17,501億円 | 按分利回り較差 | 0.002% | 97.8% | 平均利回り較差 | 0.003% |
| 国債買入 | 1,100億円 | 9/24 | 応札 | 3,854億円 | 落札 | 1,103億円 | 按分利回り較差 | 0.002% | 97.0% | 平均利回り較差 | 0.002% |
| 国債買入 | 3,000億円 | 9/24 | 応札 | 9,295億円 | 落札 | 3,005億円 | 按分利回り較差 | -0.002% | 35.1% | 平均利回り較差 | -0.001% |
| 国債買入 | 2,000億円 | 9/24 | 応札 | 6,260億円 | 落札 | 2,003億円 | 按分利回り較差 | 0.002% | 30.3% | 平均利回り較差 | 0.002% |

被災地支援(第41回) 9/26~2015/9/25 (364日間) 貸付予定総額 975億円(大手行 0億円、地域金融機関等975 億円) 貸付利率0.10 %

J-REIT買入 6億円 約定日 9/19

| 《 9/22の日銀調節とレート予想 》 | | | | | |
|---------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 1,605,500 | 前日比 | 75,100 |
| 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1兆円減の120兆1,000億円(当座預金残高見込みは153兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.066~0.069%での調達、大手行からは0.065%での調達希望と、週末要因から昨日までと比べてやや強めの展開が始まった。一巡後も同水準での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W物0.117%、2W~1M物で0.118%の調達が見られた。

《 19日のオープン市場動向 》

短国現先S/Nは発行日要因の剥落や、短国買入オペの影響から小幅低下となった。短国アウトライト市場は3M:▲0.003~0.00%、1Y:▲0.001%の出合いが見られた。短国買入オペは1兆7,500億円で開催され、按分利回り較差+0.002%、平均利回り較差+0.003%と、小甘い結果になった。CP市場は償還総額600億円程度に対し、ノンバンク、石油業態等の大型発行案件があり、発行総額は1,300億円程度となった。発行レートは横ばい圏での推移となった。

《 22日の材料 》

*米国8月の中古住宅販売

| 《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 | 0.560 | ▲ 0.005 | 日経平均株価(終値) | 16,321.17 | 253.60 | 為替(9時) | 108.80-82 |
| | | | | | | 為替(5時) | 109.10-11 |

| 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 | 9/11 | 9/12 | 9/16 | 9/17 | 9/18 | 9/19 |
| 日銀当預残 | 1,518,800 | 1,521,300 | 1,504,100 | 1,534,400 | 1,533,600 | 1,530,400 |
| 準備預金残 | 1,386,500 | 1,390,800 | 1,374,600 | 1,405,100 | 1,411,300 | 1,399,800 |
| レート | 0.067% | 0.070% | 0.067% | 0.066% | 0.068% | 0.069% |
| 月中平均 | 0.06936% | 0.06953% | 0.06938% | 0.06918% | 0.06911% | 0.06910% |

「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