

◀ 資金需給 ▶

単位 億円

	26日需給速報		27日需給予想	28日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	▲ 400	▲ 1,000
財政		9,400	1,500	▲ 5,000
資金過不足		9,500	1,100	▲ 6,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
105,671				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		30,000		
国庫短期証売却				
国債買入		9,200		
CP等買入				4,100
		▲ 400	▲ 500	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488				
被災地支援				
3,623				
社債等買入		▲ 200		
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		38,500	▲ 400	4,100
当預増減		48,000	700	▲ 1,900

当座預金残高	1,528,100	8/26以降の残り所要積立額	63,600
準備預金残高	1,395,900	8/27以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,163,900	積数	53,700
超過準備	1,162,600	1日平均	2,700
非準預先残高	132,200	積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	1,901,100
準備預金進捗率	97.18% (実績)		35.48% (日数)

◀ 8/27の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,528,800	前日比	700
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.06~0.07%程度での出合いが中心になると見込まれる。

◀ 26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5兆円増加の117兆1,000億円(当座預金残高見込みは152兆7,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは大手行から0.06%、信託、証券業態から0.064~0.065%前後の出合いで始まった。一巡後は大手行を含め0.06%近辺での出合いが散見された。また、一部業態から試し取りと見られる調達も行われた。米ドル資金供給オペが1W物でオフアされ、100万ドルの落札となった。

◀ 26日のオープン市場動向 ▶
 現先取引S/Nは横ばい圏での推移となった。短国市場は閑散な地合いが続いており、3M物で0.031%の出合いが見られた程度であった。CP発行市場は、月末前倒し発行案件が出たこともあって発行総額は3,500億円弱に膨らんだ。昨日のCP等買入オペの利回り上昇もあり、発行レートは概ね上昇した。

◀ 27日の材料 ▶
 *特にありません

JGB新発10年債	0.495	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	15,521.22	▲ 92.03	為替(9時)	104.07-08
						為替(5時)	103.88-90

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	8/19	8/20	8/21	8/22	8/25	8/26
日銀当預残	1,528,200	1,511,200	1,500,300	1,501,800	1,480,100	1,528,100
準備預金残	1,392,100	1,372,000	1,363,500	1,363,600	1,350,600	1,395,900
レート	0.067%	0.073%	0.067%	0.068%	0.068%	0.071%
月中平均	0.06795%	0.06820%	0.06814%	0.06813%	0.06812%	0.06823%

8/25のマネタリーベース				2,392,000		
8/25コール	合計	163,137	無担	66,548	有担	96,589
コール前日増減	計	▲ 2,471	無担	▲ 2,395	有担	▲ 76

8/26の加重平均レート(速報)				8/25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		
0.050 ~0.135 (0.071)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.055 ~0.135 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.062 ~0.120 (0.079)				T/N		0.065 ~0.120 (0.071)		
				S/N				
0.100 ~0.120 (0.120)				1W	0.200 ~0.400 (0.258)			
0.330 (0.330)				2W	0.118 (0.118)			
0.116 ~0.175 (0.121)				3W				
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.0310	3M	0.120 (0.120)			
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

◀ オペ情報、入札結果 ▶

国債補完 2,000億円 8/26 ~ 8/27 (1日間) 応札 53億円 落札 53億円 -0.400% 全取 平均 -0.414%(即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 8/28~9/5 (8日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.580%
 40年利付国債(表面利率1.7%) 応札1兆145億円 落札3,994億円 8/28~2054/3/20 1.760% 按分 74.2553%
 交付税特会 1兆500億円 9/3~2015/3/4 応札 3兆7,095億円 落札 1兆500億円 0.098% 按分 15.7115% 平均 0.095%

「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