

<<資金需給>>

単位 億円

	27日需給速報		28日需給予想	29日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 1,500	▲ 700
財政		1,400	▲ 5,700	3,100
資金過不足		1,000	▲ 7,200	2,400
貸出			▲ 100	
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				6,100
105,671				▲ 12,100
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入				5,300
CP等買入		▲ 500	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488				
被災地支援				500
3,623				▲ 600
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給	即日	100	200	
		▲ 200		
小計		▲ 600	3,800	▲ 800
当預増減		400	▲ 3,400	1,600

当座預金残高	1,528,500	8/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,391,700		53,700
積み終了先	1,161,800	8/28以降の残り所要積立額	
超過準備	1,160,900	積数	45,100
非準備先残高	136,800	1日平均	2,400
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	97.63% (実績)		38.71% (日数)

8/26のマナタリーベース		2,439,900	
8/26コール	合計	164,935 無担	68,138 有担
96,797			
コール前日増減	計	1,798 無担	1,590 有担
208			

8/27の加重平均レート(速報)				8/26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		有担当日分	
0.055 ~0.135 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)					O/N	0.050 ~0.135 (0.071)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.063 ~0.120 (0.101)						T/N		0.062 ~0.120 (0.079)	
0.125 (0.125)						S/N			
0.150 (0.150)						1W	0.100 ~0.120 (0.120)		
0.330 (0.330)						2W	0.330 (0.330)		
0.143 (0.143)						3W	0.116 ~0.175 (0.121)		
0.118 (0.118)				0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)		有担先日付分
				0.08-0.12	0.0250	2M			
				0.08-0.12	0.0310-0.0320	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	8/29	~ 12/9 (102日間)	応札	6,085億円	落札	6,085億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	2,000億円	8/27	~ 8/28 (1日間)	応札	160億円	落札	160億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	8/29	応札	12,306億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	0.000%	61.5%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	1,000億円	8/29	応札	3,387億円	落札	1,005億円	按分利回り較差	0.005%	35.1%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	300億円	8/29	応札	1,527億円	落札	301億円	按分利回り較差	0.010%	46.7%	平均利回り較差	0.012%

<< 8/28の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,525,100	前日比	▲ 3,400
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。

<< 27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2,000億円増加の117兆3,000億円(当座預金残高見込みは152兆9,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06%、地銀および信託業態から0.064%前後の調達希望で始まった。一巡後以降は0.06~0.062%近辺で出合いが散見されつつ、本日の取引を終了した。3M物の共通担保オペが1兆5,000億円オファーされ、結果は落札総額6,085億円と札割れになり、29日の期落ち分12,095億円に対してほぼ半減でのロールとなった。

<< 27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3M物で0.031~0.032%の出合いが見られた程度で、動意に乏しい地合いであった。CP発行市場は月末取引にあたり、幅広い業態からまとまった発行が見られたことで、発行総額は6,500億円に膨らんだ。期間・業態を問わず全体的に発行レートは上昇した。

<< 28日の材料 >>
 *米国4-6月期のGDP改定値
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、9/1発行)
 *2年利付国債入札(27,000億円、9/16発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、9/5借入)

JGB新発10年債	0.495	0.000	日経平均株価(終値)	15,534.82	13.60	為替(9時)	104.08-10
						為替(5時)	103.90-91

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	8/20	8/21	8/22	8/25	8/26	8/27
日銀当預残	1,511,200	1,500,300	1,501,800	1,480,100	1,528,100	1,528,500
準備預金残	1,372,000	1,363,500	1,363,600	1,350,600	1,395,900	1,391,700
レート	0.073%	0.067%	0.068%	0.068%	0.071%	0.067%
月中平均	0.06820%	0.06814%	0.06813%	0.06812%	0.06823%	0.06819%

「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りする書面や目録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