

<<資金需給>>

単位 億円

	28日需給速報		29日需給予想	1日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,600	▲ 700	1,000
財政		▲ 5,600	100	▲ 15,000
資金過不足		▲ 7,200	▲ 600	▲ 14,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			6,100	1,500
105,671			▲ 12,100	▲ 1,400
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			5,500	
CP等買入		4,100	▲ 4,000	
		▲ 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		200		
小計		3,900	▲ 4,600	100
当預増減		▲ 3,300	▲ 5,200	▲ 13,900

8/29の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,520,000	前日比	▲ 5,200
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。

<< 28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9,000億円減少の116兆4,000億円(当座預金残高見込みは152兆5,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06%、信託・証券業態を中心に0.064~0.65%の調達希望で始まった。一部業態から0.125%での試し取りが見られる中、一巡後は0.06~0.063%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8,000億円オフアールされ、落札総額1,470億円で札割れとなった。

<< 28日のオープン市場動向 >>
 現先取引S/Nは概ね横ばいでの推移となった。短国市場は3M物の入札が実施された。WI取引で0.032%まで買い進まれたものの、各利回りは平均0.0344%・按分0.0381%と市場予想通りの結果であった。落ち着いた地合いを反映し、セカンダリー市場では0.034~0.037%の出合いが見られた程度であった。CP市場は月初取引ながら鉄鋼・電機業態からまとまった額の発行があり、総額3,300億円弱に膨らんだ。昨日の月末大量発行を経て購入姿勢はやや慎重となっており、0.10%近辺での発行が目立っていた。

- << 29日の材料 >>
- *7月の完全失業率(市場予想: 3.7%)
 - *7月の有効求人倍率(市場予想: 1.10倍)
 - *7月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比▲3.0%)
 - *7月全国・8月都区部消費者物価指数(CPI)
 - 市場予想: 全 国(7月)前年同月比(除く生鮮): +3.3%
 - 東京都区部(8月)前年同月比(除く生鮮): +2.7%
 - *7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想: 前月比+1.0%)
 - *7月の商業販売統計速報 *7月の住宅着工統計
 - *米国7月の個人所得・消費支出 *米国8月のシカゴPM景況感指数

当座預金残高	1,525,200	8/28以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,381,000		45,100
積み終了先	1,157,100	8/29以降の残り所要積立額	
超過準備	1,155,400	積数	38,900
非準預先残高	144,200	1日平均	2,200
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	97.95% (実績)	41.94% (日数)	

JGB新発10年債	0.485	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	15,459.86	▲ 74.96	為替(9時)	103.87-88
						為替(5時)	103.75-77

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	8/21	8/22	8/25	8/26	8/27	8/28
日銀当預残	1,500,300	1,501,800	1,480,100	1,528,100	1,528,500	1,525,200
準備預金残	1,363,500	1,363,600	1,350,600	1,395,900	1,391,700	1,381,000
レート	0.067%	0.068%	0.068%	0.071%	0.067%	0.074%
月中平均	0.06814%	0.06813%	0.06812%	0.06823%	0.06819%	0.06839%

8/27のマネタリーベース					2,440,700	
8/27コール	合計	167,503	無担	71,718	有担	95,785
コール前日増減	計	2,568	無担	3,580	有担	▲ 1,012

8/28の加重平均レート(速報)				8/27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		
0.060 ~0.135 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.135 (0.067)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.067 ~0.121 (0.079)					0.063 ~0.120 (0.101)			
					0.125 (0.125)			
0.125 (0.125)					0.150 (0.150)			
					0.330 (0.330)			
					0.143 (0.143)			
0.090 ~0.118 (0.116)		0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.0320-0.0381	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>
 全店共通 8,000億円 9/1 ~ 12/1 (91日間) 応札 1,470億円 落札 1,470億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札27兆7,463億円 落札5兆2,217億4,000万円(非競争入札:4,782億円) 9/1~12/1 0.0381% 按分16.1517% 平均0.0344%
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札14兆5,140億円 落札2兆4,695億円(I非競争入札:2,268億円) 9/16~2016/9/15 0.069% 按分25.6201% 平均0.067%
 交付税特会 1兆500億円 9/5~2015/3/6 応札 3兆8,163億円 落札 1兆500億円 0.093% 按分 69.6203% 平均 0.092%
 ETF買入 156億円 約定日 8/28

「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