

<<資金需給>>

単位 億円

	29日需給速報		1日需給予想		2日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600		1,100		1,000
財政		600		▲ 22,700		▲ 10,000
資金過不足		0		▲ 21,600		▲ 9,000
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		
99,661		▲ 12,100		▲ 1,400		
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		5,500				6,400
CP等買入						
		▲ 4,000		▲ 300		
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488						
被災地支援		500				
3,522		▲ 600				
社債等買入						
ETF買入						
国債補充供給						
小計		▲ 4,600		▲ 200		23,900
当増増減		▲ 4,600		▲ 21,800		14,900
当座預金残高	1,520,600		8/29以降の残り所要積立額			
準備預金残高	1,389,000					38,900
積み終了先	1,166,900		9/1以降の残り所要積立額			
超過準備	1,166,300					積数 27,800
非準備先残高	131,600					1日平均 1,900
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)						1,900,800
準備預金進捗率	98.54%		(実績)	51.61%		(日数)

9/1の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,498,800	前日比	▲ 21,800
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。

<< 29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1,000億円減少の116兆3,000億円(当座預金残高見込みは152兆円)。無担O/Nは週末要因からビッドが少々強まり、大手行から0.065%、信託、証券業態から0.066~0.068%近辺の調達希望で始まった。一巡後も同水準での出合いが散見される中、本日の取引を終了した。ターム物はロール案件の取引が中心となった。

<< 29日のオープン市場動向 >>

現先取引S/Nは午後から若干低下傾向となった。短国市場は、国庫短期証券買入オペが17,500億円で実施された。各利回り較差は平均△0.001%・按分△0.005%となり、市場予想に反して需給の改善が窺える強い結果となった。オペ後は3M物が0.022%まで買い進まれた。CP市場は石油・電機業態からまとまった発行があったものの、案件数が少なく発行総額は1,000億円程度にとどまった。発行レートは依然上昇傾向であった。

<< 1日の材料 >>

- *4-6月期の法人企業統計調査季報
- *9月実績/10月見込み財政資金対民間収支
- *米国休場 (Labor Day)

コールド8月の加重平均レート			
(土日を含む)	無担	0.06855%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06862%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	103.71-73
0.490 ▲ 0.005	15,424.59 ▲ 35.27	為替(5時)	103.82-84

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	8/22	8/25	8/26	8/27	8/28	8/29
日銀当預残	1,501,800	1,480,100	1,528,100	1,528,500	1,525,200	1,520,600
準備預金残	1,363,600	1,350,600	1,395,900	1,391,700	1,381,000	1,389,000
レート	0.068%	0.068%	0.071%	0.067%	0.074%	0.070%
月中平均	0.06813%	0.06812%	0.06823%	0.06819%	0.06839%	0.06855%

8/28のマネターベース		2,439,000	
8/28コール合計	165,165	無担	67,610
有担	97,555		
コール前日増減	▲ 2,338	無担	▲ 4,108
有担	1,770		

8/29の加重平均レート(速報)				8/28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	有担先日付分		
0.050 ~0.135 (0.070)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.135 (0.074)			0.030 ~0.040 (0.031)		
0.065 ~0.121 (0.084)				T/N			0.067 ~0.121 (0.079)		
				S/N					
0.070 ~0.200 (0.121)				1W		0.125	(0.125)		
0.118 (0.118)				2W					
				3W					
0.155 (0.155)		0.08-0.12	-	1M		0.090 ~0.118 (0.116)			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12	0.0220-0.0340	3M					
		-	-	6M					
		-	-	1Y					

<< オペ情報、入札結果 >>

国短買入	17,500億円	9/2	応札	23,628億円	落札	17,501億円	按分利回り較差	-0.005%	11.0%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	3,000億円	9/2	応札	10,987億円	落札	3,001億円	按分利回り較差	0.005%	89.2%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,000億円	9/2	応札	8,781億円	落札	2,002億円	按分利回り較差	0.007%	33.4%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	1,400億円	9/2	応札	5,261億円	落札	1,406億円	按分価格較差	-0.15%	50.4%	平均価格較差	-0.188円

- 成長基盤強化(本則第17回) 9/5~2018/9/3 (1,459日間) 貸付予定額 6,568億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 71先
- 成長基盤強化(本則第13回の借り換え) 9/5~2015/9/4 (364日間) 貸付予定額 1,527億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 62先
- 成長基盤強化(本則第9回の借り換え) 9/5~2015/9/4 (364日間) 貸付予定額 1,117億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 56先
- 成長基盤強化(本則第5回の借り換え) 9/5~2015/9/4 (364日間) 貸付予定額 914億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 63先
- 成長基盤強化(ABL等特則第13期) 9/5~2018/9/4 (1,460日間) 貸付予定額 29億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 7先
- 成長基盤強化(ABL等特則第5期) 9/5~2016/9/5 (731日間) 貸付予定額 2億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 2先
- 成長基盤強化(小口特則第10期) 9/5~2018/9/3 (1,459日間) 貸付予定額 11.73億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 23先
- 成長基盤強化(小口特則第6期の借り換え) 9/5~2015/9/4 (364日間) 貸付予定額 2.49億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 12先
- 成長基盤強化(小口特則第2期の借り換え) 9/5~2015/9/4 (364日間) 貸付予定額 4.64億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 10先
- 成長基盤強化(米ドル特則第9期) 9/5~2015/9/4 (364日間) 貸付予定額 1,562百万ドル 貸付先数 35先
- 成長基盤強化(米ドル特則第5期の借り換え) 9/5~2015/9/4 (364日間) 貸付予定額 1,380百万ドル 貸付先数 21先

ETF買入 156億円 約定日 8/29

J-REIT買入 5億円 約定日 8/29

「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