

《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		▲ 700	▲ 1,100	▲ 2,000
財政		1,800	▲ 2,500	2,000
資金過不足		1,100	▲ 3,600	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				9,400
66,190				▲ 11,300
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				11,800
CP等買入				
		▲ 200	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援				400
3,241				▲ 500
社債等買入				
ETF買入		300	200	
国債補完供給				
小計		100	0	9,800
当預増減		1,200	▲ 3,600	9,800

当座預金残高	2,310,600	8/26以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,102,400		15,600
積み終了先	1,754,200	8/27以降の残り所要積立額	
超過準備	1,752,300	積数	12,000
非準備先残高	208,200	1日平均	600
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)			2,028,500
準備預金進捗率	99.41% (実績)		35.48% (日数)

8/25のマネタリーベース		3,267,100	
8/25コール	合計	209,332	無担 80,110 有担 129,222
コール前日増減	計	▲ 3,970	無担 1,158 有担 ▲ 5,128

8/26の加重平均レート(速報)				8/25の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.060 ~0.125 (0.080)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.073 ~0.120 (0.090)					0.073 ~0.125 (0.092)		
0.070 ~0.122 (0.091)				1W	0.150 (0.150)	0.130 ~0.165 (0.143)	
0.114 ~0.118 (0.117)				2W		0.116 ~0.170 (0.124)	
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.012~▲0.01	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

《オペ情報、入札結果》

全店共通	15,000億円	8/28 ~ 12/8 (102日間)	応札	9,350億円	落札	9,350億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債買入	3,750億円	8/28	応札	19,507億円	落札	3,754億円	按分利回り較差	0.006%	66.8%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,250億円	8/28	応札	14,780億円	落札	4,253億円	按分利回り較差	0.003%	44.6%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	2,400億円	8/28	応札	7,311億円	落札	2,408億円	按分利回り較差	0.000%	4.5%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	1,400億円	8/28	応札	5,316億円	落札	1,405億円	按分利回り較差	-0.003%	9.6%	平均利回り較差	0.002%
CP買入	3,500億円	8/31	応札	7,358億円	落札	3,484億円	按分利回り較差	0.084%	73.3%	平均利回り較差	0.086%

J-REIT買入 13億円 約定日 8/26

「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。」

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	2,307,000	前日比	▲ 3,600
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.07%台半ばでの出合いが中心になると予想される。

《 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、175兆6,000億円(当座預金残高見込みは、231兆円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.073~0.076%、大手行からは0.074~0.075%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.076~0.077%と昨日と同水準の立ち上がりとなった。一巡後は、調達レートが低下し、0.07~0.075%での出合いが散見されつつ本日の取引を終えた。また、一部業態が試し取りを行った為、加重平均レートが上昇した。ターム物に関しては、昨日に続き大手行が2W物0.118%で調達を行った。3M物の共通担保オペが1兆5,000億円オファーされ、応札額9,350億円(期落ち分1兆1,251億円)と札割れの結果となった。

《 26日のオープン市場動向 》
 現先レートS/Nは、横ばい圏で推移した。短国市場は、入札を翌日に控えて材料に乏しい中、3M：▲0.012~▲0.01%が小額出合った程度であった。CP市場は、多くの業態から調達を実施され、発行総額は2,300億円程度となった。発行レートは概ね横ばい。また、CP等買入オペが実施され、按分利回0.084%平均落札利回0.086%となり、前日比(按分0.085%平均0.089%)で若干低下した。

《 27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、51,000億円、8/31発行)
 *2年利付国債入札(25,000億円、9/15発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、9/4借入)

JGB新発10年債	0.370	0.000	日経平均株価(終値)	18,376.83	570.13	為替(9時)	118.57-59
						為替(5時)	119.26-29

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	8/24	8/25	8/26
日銀当預残	2,301,200	2,271,000	2,282,900	2,272,900	2,309,400	2,310,600
準備預金残	2,093,500	2,061,400	2,076,900	2,071,400	2,102,100	2,102,400
レート	0.077%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.080%
月中平均	0.07516%	0.07520%	0.07543%	0.07546%	0.07548%	0.07565%

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