

<<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想		4日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		500		100		0
財政		▲ 15,700		▲ 5,400		3,000
資金過不足		▲ 15,200		▲ 5,300		3,000
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)					8,200	▲ 7,200
64,973						
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		12,000				12,000
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金					6,800	
(成長) 48,511						▲ 3,800
(増加) 244,836						
被災地支援						
3,166						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
ETF買入						
国債補充供給						
小計		11,800		▲ 200		16,000
当預増減		▲ 3,400		▲ 5,500		19,000

当座預金残高	2,320,000	9/2以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,110,000		5,200
積み終了先	1,766,200	9/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,766,100	積数	4,300
非準備先残高	210,000	1日平均	300
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)			2,022,700
準備預金進捗率	99.79% (実績)	58.06% (日数)	

9/1のマナターレーベース		3,282,400	
9/1コール 合計	213,163 無担	76,468 有担	136,695
コール前日増減 計	11,324 無担	13,158 有担	▲ 1,834

9/2 の加重平均レート(速報)				9/1 の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.050 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)	CP気配a-1	短国	O/N	0.053 ~0.125 (0.076)	無担先日付分	有担先日付分
0.072 ~0.130 (0.085)				T/N		0.073 ~0.120 (0.080)	
0.122 (0.122)				S/N			
0.145 (0.145)				1W		0.125 ~0.140 (0.130)	
				2W	0.118 (0.118)	0.170 (0.170)	
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	-	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	9/4	~ 12/15 (102日間)	応札	8,210億円	落札	8,210億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債買入	4,000億円	9/4		応札	15,262億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.006%	29.4%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	4,000億円	9/4		応札	16,234億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	0.003%	69.8%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	4,000億円	9/4		応札	10,014億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.000%	9.7%	平均利回り較差	0.004%
J-REIT買入	13億円	約定日	9/2									

「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

<< 9/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,314,500	前日比	▲ 5,500
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.075%前後の出合いが中心になると予想される。

<< 2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3,000億円減の176兆9,000億円(当座預金残高見込みは232兆円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態から0.07~0.075%での調達が始まった。その後は、まとまった金額に対しては0.076~0.077%での調達も散見された。また、一部邦銀から0.125%での試し取りが行われた。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が複数見られた。

<< 2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。短国市場は動意に乏しく、終日閑散だった。CP市場は鉄鋼業態から大型発行案件が見られたものの、全体の発行件数が少なく、発行総額は1,000億円程度となった。発行レートは横ばい圏で推移した。

- << 3日の材料 >>
- *木内日銀審議委員、青森県金融経済懇談会にて講演
 - *ECB定例理事会
 - *米国7月の貿易収支
 - *8月のISM非製造業景況指数
 - *国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、9/7発行)
 - *流動性供給入札(3,000億円、9/7発行)
 - *交付税特別会計借入(10,500億円、9/11借入)

<<コール8月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07555%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07638%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.390	0.005	日経平均株価(終値)	18,095.40	▲ 70.29	為替(9時)	119.70-73
						為替(5時)	120.05-08

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	8/26	8/27	8/28	8/31	9/1	9/2
日銀当預残	2,310,600	2,307,400	2,315,900	2,314,300	2,323,400	2,320,000
準備預金残	2,102,400	2,098,700	2,101,700	2,100,900	2,112,900	2,110,000
レート	0.080%	0.076%	0.076%	0.071%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07565%	0.07567%	0.07568%	0.07555%	0.07600%	0.07650%