

<<資金需給>>

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想		7日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		100		100		2,000
財政		▲ 5,000		4,700		▲ 3,000
資金過不足		▲ 4,900		4,800		▲ 1,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)				8,200		600
64,973				▲ 7,200		▲ 700
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				12,100		
CP等買入						
		▲ 100		▲ 400		
貸出支援基金				6,800		
(成長) 48,511						
(増加) 244,836				▲ 5,400		
被災地支援						
3,166						
社債等買入		▲ 100				
ETF買入						
国債補完供給						
小計		▲ 200		14,100		▲ 100
当増減		▲ 5,100		18,900		▲ 1,100

当座預金残高	2,314,900	9/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,104,400		4,300
積み終了先	1,760,600	9/4以降の残り所要積立額	
超過準備	1,760,600	積数	3,800
非準備先残高	210,500	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	99.81% (実績)	61.29% (日数)	

9/2のマナタリーベース				3,278,500		
9/2コール	合計	208,252	無担	74,231	有担	134,021
コール前日増減	計	▲ 4,911	無担	▲ 2,237	有担	▲ 2,674

9/3の加重平均レート(速報)				9/2の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分	
0.060 ~0.125 (0.077)	0.030	~0.040 (0.031)		0.050 ~0.125 (0.077)		0.072 ~0.130 (0.085)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.072 ~0.120 (0.083)									
0.125 (0.125)									
0.100 ~0.117 (0.103)						0.122 (0.122)			
0.114 ~0.116 (0.114)						0.145 (0.145)			
0.119 (0.119)		0.08-0.13	-					有担先日付分	
		0.08-0.12	-						
		0.08-0.12	▲0.006-0.000						
		-	-						
		-	-						

<< 9/4の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,333,800	前日比	18,900
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%台後半の出合いが中心になると予想される。

<< 3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9,000億円減の176兆円(当座預金残高見込みは231兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀業態から0.074~0.075%での調達が始まった。その後は、まとまった金額に対して0.075~0.077%での調達が複数散見された。また、本日も一部邦銀から0.125%での試し取りが行われた。ターム物は、証券業態の調達が数件見られた程度であった。

<< 3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3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.006~▲0.004%の出合いが見られたことで、平均落札利回りは▲0.0032%と強めになったものの、按分落札利回りは0.000%(按分率0.8453%)と概ね事前予想通りの結果となった。事前予想通りの結果となったことで、セカンダリーでは動意薄となり、▲0.001~0.000%の出合いが散見された程度であった。CP市場は発行総額700億円弱と発行件数が少なく、閑散となった。発行レートは概ね横ばいで推移した。CP等買入オペは前回比1,500億円増額の5,000億円でオファーされたことから、各落札利回りは平均0.083%、按分0.075%と前回(0.086%、0.084%)から低下した。

<< 4日の材料 >>
 *7月の毎月勤労統計調査速報
 *米国8月の雇用統計
 *ユーロ圏4-6月期のGDP改定値

<<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	0.395	0.005	日経平均株価(終値)	18,182.39	86.99	為替(9時)	120.62-63
						為替(5時)	120.37-39

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	8/27	8/28	8/31	9/1	9/2	9/3
日銀当座預残	2,307,400	2,315,900	2,314,300	2,323,400	2,320,000	2,314,900
準備預金残	2,098,700	2,101,700	2,100,900	2,112,900	2,110,000	2,104,400
レート	0.076%	0.076%	0.071%	0.076%	0.077%	0.077%
月中平均	0.07567%	0.07568%	0.07555%	0.07600%	0.07650%	0.07667%

<<オペ情報、入札結果>>
 全店共通 8,000億円 9/7 ~ 12/7 (91日間) 応札 580億円 落札 580億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 CP買入 5,000億円 9/8 応札 8,556億円 落札 4,985億円 按分レート 0.075% 64.6% 平均落札レート 0.083%
 T-Bill3M 応札19兆1,147億円 落札4兆6,664億円(非競争入札:4,335億円) 9/7~12/7 0.000% 按分0.8453% 平均▲0.0032%
 流動性供給 応札 1兆821億円 落札 2,978億円 9/7 募入最大利回較差 0.003% 按分 67.7376% 募入平均利回較差 0.001%
 交付税特会 1兆500億円 9/11~2016/3/11 応札3兆30億円 落札1兆500億円 0.072% 按分52.1250% 平均0.068%

「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