

<<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		7日需給予想	8日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	1,600	1,000
財政		3,500	▲ 7,500	1,000
資金過不足		3,700	▲ 5,900	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		8,200	600	9,200
65,973		▲ 7,200	▲ 700	▲ 7,200
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				6,000
国庫短期証売却				
国債買入		12,100		4,500
CP等買入				5,000
		▲ 400	▲ 200	
貸出支援基金		6,800		
(成長) 51,505				
(増加) 244,836		▲ 5,400		
被災地支援				
3,166				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 300	300	
小計		13,800	0	17,500
当預増減		17,500	▲ 5,900	19,500

当座預金残高	2,332,400	9/4以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,123,300		3,800
積み終了先	1,777,900	9/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,777,900	積数	2,400
非準備先残高	209,100	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	99.88%	(実績)	70.97% (日数)

9/3のマネタリーベース		3,273,200	
9/3コール	合計	204,598	無担 72,906 有担 131,692
コール前日増減	計	▲ 3,654	無担 ▲ 1,325 有担 ▲ 2,329

9/4の加重平均レート(速報)			9/3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 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.120 (0.082)				T/N	0.072 ~0.120 (0.083)	
0.125 (0.125)				S/N	0.125 (0.125)	
0.117 (0.117)				1W	0.100 ~0.117 (0.103)	
				2W	0.114 ~0.116 (0.114)	
				3W		
		0.08-0.13	-	1M	0.119 (0.119)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.002-▲0.001	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	9/8	~ 12/18 (101日間)	応札	9,160億円	落札	9,160億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	4,000億円	9/4	~ 9/7 (3日間)	応札	243億円	落札	243億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	6,000億円	9/8	応札	10,805億円	落札	6,001億円	按分利回り較差	0.000%	91.1%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	700億円	9/8	応札	1,592億円	落札	701億円	按分利回り較差	0.047%	47.7%	平均利回り較差	0.057%
国債買入	2,400億円	9/8	応札	9,971億円	落札	2,409億円	按分利回り較差	-0.008%	75.4%	平均利回り較差	-0.007%
国債買入	1,400億円	9/8	応札	5,778億円	落札	1,409億円	按分利回り較差	-0.014%	50.6%	平均利回り較差	-0.012%
ETF買入	317億円	約定日	9/4								

<< 9/7の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,326,500	前日比	▲ 5,900
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.075%前後の出合いが中心になると予想される。

<< 4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2兆2,000億円増の178兆2,000億円(当座預金残高見込みは233兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.075%での調達で始まった。その後、大手行を含む複数の業態から、まとまった金額に対して0.075~0.078%での調達が散見された。週末要因により、昨日までと比べやや強めの取引となったが、一巡後は散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W物0.117%でまとまった調達が見られた。

<< 4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。短国市場は短国買入オペが前回比2,000億円減額の6,000億円でオファーされ、平均利回較差+0.002%、按分利回較差0.000%と概ね市場実勢水準での落ち着いた結果となった。オペ後は3M物で▲0.002~▲0.001%の出合いが見られた。CP市場は発行件数が少なく、発行総額は500億円程度と閑散だった。発行レートは昨日のオペを受け小幅低下となった。

<< 7日の材料 >>

- *7月の景気動向指数速報
- *8月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *米国休日(Labor Day)

<<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	0.365	▲ 0.030	日経平均株価(終値)	17,792.16	▲ 390.23	為替(9時)	120.11-13
						為替(5時)	119.22-24

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	8/28	8/31	9/1	9/2	9/3	9/4
日銀当預残	2,315,900	2,314,300	2,323,400	2,320,000	2,314,900	2,332,400
準備預金残	2,101,700	2,100,900	2,112,900	2,110,000	2,104,400	2,123,300
レート	0.076%	0.071%	0.076%	0.077%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07568%	0.07555%	0.07600%	0.07650%	0.07667%	0.07633%

「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