

<<資金需給>>

単位 億円

	27日需給速報		28日需給予想	31日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,200	▲ 1,400	900
財政		▲ 2,000	100	1,500
資金過不足		▲ 3,200	▲ 1,300	2,400
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			9,400	1,600
66,190			▲ 11,300	▲ 2,100
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				3,500
		▲ 200	▲ 400	
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		200	300	
国債補充供給				
小計		0	10,000	3,000
当預増減		▲ 3,200	8,700	5,400

当座預金残高	2,307,400	8/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,098,700		12,000
積み終了先	1,751,000	8/28以降の残り所要積立額	
超過準備	1,751,000	積数	10,200
非準備先残高	208,700	1日平均	500
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	99.50% (実績)	38.71% (日数)	

8/26のマネタリーベース		3,269,100	
8/26コール	合計	210,010	無担 82,552 有担 127,458
コール前日増減	計	678	無担 2,442 有担 ▲ 1,764

8/27の加重平均レート(速報)				8/26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 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)		O/N	0.060 ~0.125 (0.080)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.075 ~0.120 (0.085)				T/N		0.073 ~0.120 (0.090)		
				S/N				
0.098 ~0.117 (0.103)				1W		0.070 ~0.122 (0.091)		
0.118 (0.118)				2W		0.114 ~0.118 (0.118)		
				3W				
0.250 (0.250)		0.08-0.13	-	1M				有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.000~▲0.007	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.08	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	8/31 ~ 11/30 (91日間)	応札	1,560億円	落札	1,560億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	2,089億円	8/27 ~ 8/28 (1日間)	応札	11億円	落札	11億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
T-Bill3M	応札17兆7,018億円	落札4兆6,230億6,000万円(非競争入札:4,269億円)	8/31~11/30	▲0.0020%	按分	17.2349%	平均	▲0.0056%		
2年利付国債(表面利率0.1%)	応札10兆965億円	落札2兆3,009億円(I非競争入札:1,984億円)	9/15~2017/9/15	0.009%	按分	46.1133%	平均	0.008%		
交付税特会	1兆500億円	9/4~2016/3/4	応札2兆9,264億円	落札1兆500億円	0.075%	按分	38.6809%	平均	0.074%	

「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。」

8/28の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,316,100	前日比	8,700
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。

<< 27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、175兆4,000億円(当座預金残高見込みは、230兆7,000億円)。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%となった。一巡後は、まとまった金額の取引に関しては0.07%台半ば、少額取引では0.07%での出合いが数件見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが散見される程度であった。3M物の共通担保オベが8,000億円オファーされ、応札額1,560億円(期落ち分2,070億円)と札割れの結果となった。

<< 27日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、同水準で推移した。短国市場は、新発3Mの入札が実施された。WI取引で強めの出合いが見られた事もあり、平均落札利回りは▲0.0056%となったものの、最高落札利回りは▲0.0020%と、ほぼ事前予想通りの結果となった。アウトライトは、3M:0.00~▲0.007%、1Y:▲0.08%での出合いが見られた。CP市場は、発行日が月末に該当することから、多くの業態から実施され、発行総額は8,700億円となった。入札案件の総額が償還比でやや少なかったことから、発行レートは若干低下した。

<< 28日の材料 >>
 *7月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+1.3%)
 *7月の完全失業率(市場予想:3.4%)
 *7月の有効求人倍率(市場予想:1.19倍)
 *7月全国・8月都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想:全 国(7月)前年同月比(除く生鮮):▲0.2%
 東京都区部(8月)前年同月比(除く生鮮):▲0.2%
 *7月の商業動態統計速報
 *米国7月の個人所得・消費支出
 *英国4-6月期のGDP改定値

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.05-06
0.385	0.015	18,574.44	197.61
		為替(5時)	120.43-45

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	8/20	8/21	8/24	8/25	8/26	8/27
日銀当預残	2,271,000	2,282,900	2,272,900	2,309,400	2,310,600	2,307,400
準備預金残	2,061,400	2,076,900	2,071,400	2,102,100	2,102,400	2,098,700
レート	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.080%	0.076%
月中平均	0.07520%	0.07543%	0.07546%	0.07548%	0.07565%	0.07567%

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