

<<資金需給>>

単位 億円

	1日需給速報		2日需給予想	3日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,100	1,100	1,000
財政		▲ 24,100	▲ 16,900	▲ 7,000
資金過不足		▲ 23,000	▲ 15,800	▲ 6,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,500		
99,691		▲ 1,400		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			17,500	
国庫短期証売却				
国債買入			6,400	2,400
CP等買入				
		▲ 300	▲ 100	
貸出支援基金(成長)				
34,837(増加) 133,488				
被災地支援				
3,522				
社債等買入				
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		▲ 200	23,900	2,400
当預増減		▲ 23,200	8,100	▲ 3,600
当座預金残高	1,497,400	9/1以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,365,000	27,800		
積み終了先	1,143,700	9/2以降の残り所要積立額		
超過準備	1,143,700	積数		
非準預先残高	132,400	1日平均		
		1,800		
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)		1,900,800		
準備預金進捗率	98.70%	(実績)	54.84%	(日数)

<< 9/2の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,505,500	前日比	8,100
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 1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1兆5,000億円増加の114兆8,000億円(当座預金残高見込みは149兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06%、信託・証券業態から0.065%近辺での調達希望で始まり、立ち上がりは0.065%を中心とした出合いとなった。積極的に調達をする参加者は限られていたものの、ビッドが底堅く残ったため、一巡後も0.06~0.065%での出合いで推移した。ターム物は、2W物の期間で大手行による調達が確認された。

<< 1日のオープン市場動向 >>
 短国・CP現先レートは共に横ばい圏での動きとなっていた。短国市場は、先週末に実施された短国買入オペの影響から、売り物に乏しく閑散な地合いであった。CP市場では償還総額1,200億円強に対して、発行総額は月初ということもあって500億円強にとどまった。発行レートは、動意乏しく横ばい圏での動きとなった。

<< 2日の材料 >>
 *7月の毎月勤労統計調査速報
 *8月のマネタリーベース *9月の日銀当座預金増減要因見込み
 *米国7月の建設支出
 *米国8月のISM製造業景況指数
 *10年利付国債入札(24,000億円、9/22発行)

<<コール8月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06855%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06862%	有担 0.03100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.495	0.005	15,476.60	52.01	104.17-18	104.14-16

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	8/25	8/26	8/27	8/28	8/29	9/1
日銀当預残	1,480,100	1,528,100	1,528,500	1,525,200	1,520,600	1,497,400
準備預金残	1,350,600	1,395,900	1,391,700	1,381,000	1,389,000	1,365,000
レート	0.068%	0.071%	0.067%	0.074%	0.070%	0.068%
月中平均	0.06812%	0.06823%	0.06819%	0.06839%	0.06855%	0.06800%

8/29のマネタリーベース		2,435,000	
8/29コール 合計	160,170	無担 63,758	有担 96,412
コール前日増減 計	▲ 4,995	無担 ▲ 3,852	有担 ▲ 1,143

9/1の加重平均レート(速報)				8/29の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)	有担(平均)	CP配a-1	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分		
0.050 ~0.135 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.135 (0.070)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.063 ~0.120 (0.076)				T/N	0.065 ~0.121 (0.084)			
				S/N				
0.260 ~0.400 (0.330)				1W	0.070 ~0.200 (0.121)			
0.118 (0.118)				2W	0.118 (0.118)			
0.118 (0.118)				3W				
		0.08-0.12	-	1M	0.155 (0.155)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.0150	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	9/1	~ 9/2 (1日間)	応札	4億円	落札	4億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	1,100億円	9/3	応札	2,793億円	落札	1,101億円	按分利回り較差	0.025%	37.7%	平均利回り較差	0.062%
国債買入	1,000億円	9/3	応札	4,024億円	落札	1,003億円	按分利回り較差	0.007%	27.8%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	300億円	9/3	応札	1,418億円	落札	302億円	按分利回り較差	0.003%	91.3%	平均利回り較差	0.004%

J-REIT買入 5億円 約定日 9/1

「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