

**<<資金需給>>**

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想	5日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,100	500	0
財政		▲ 2,600	8,300	3,000
資金過不足		▲ 1,500	8,800	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,600
99,691				▲ 5,400
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		2,500		9,000
CP等買入				
		▲ 100	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488				10,200
被災地支援 3,522				▲ 6,400
社債等買入				
ETF買入		100		
国債補完供給				
小計		2,500	▲ 100	10,000
当預増減		1,000	8,700	13,000

当座預金残高	1,507,400	9/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,379,600		22,000
積み終了先	1,161,500	9/4以降の残り所要積立額	
超過準備	1,161,300	積数	19,200
非準預先残高	127,800	1日平均	1,600
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	98.99% (実績)	61.29% (日数)	

9/2のマネタリーベース		2,418,500	
9/2コール	合計	158,370	無担 63,239 有担 95,131
コール前日増減	計	▲ 725	無担 1,839 有担 ▲ 2,564

9/3の加重平均レート(速報)				9/2の加重平均レート(確報)			
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	単位(%)
0.050 ~0.135 (0.069)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.135 (0.070)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.120 (0.071)					0.065 ~0.120 (0.070)		
0.117 ~0.150 (0.137)					0.117 ~0.125 (0.123)		
					0.118 (0.118)		
		0.08-0.12	-		0.115 ~0.116 (0.116)		
		0.08-0.12	-		0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.12	0.002-0.022				
		-	-				
		-	-				

<< 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	1,516,100	前日比	8,700
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。

<< 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3,000億円増加の116兆1,000億円(当座預金残高見込みは150兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06%前後、地銀・信託業態から0.063~0.065%近辺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。一巡後は0.06~0.065%での出合いで推移した。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<< 3日のオープン市場動向 >>  
 現先レートは横ばい圏での推移となった。短国市場では3M物入札(477回)が実施された。WI取引において0.020%と強めの出合いが見られる中、平均落札利回り0.0204%、按分落札利回り0.0220%、按分率66.8168%と強めの結果となった。セカンダリーはショートカバーから0.002%まで買い進まれた。CP市場は、償還総額1,000億円程度に対し発行総額は2,200億円弱となった。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。本日はCP等買入オペが前回比1,000億円増額の5,500億円で実施された。足元金利の高止まりや、売却ニーズが強い銘柄が多く含まれたことから平均落札利回り0.094%、按分落札利回り0.092%と前回比でほぼ横ばいの結果になった。

<< 4日の材料 >>  
 \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)  
 \*黒田日銀総裁定例会見  
 \*米国7月の貿易収支 \*米国8月のISM非製造業景況指数  
 \*MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)  
 \*ECB定例理事会(金融政策発表あり)

<<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	0.530	0.030	日経平均株価(終値)	15,728.35	59.75	為替(9時)	105.23-24
						為替(5時)	104.95-97

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	8/29	9/1	9/2	9/3
日銀当預残	1,528,500	1,525,200	1,520,600	1,497,400	1,506,400	1,507,400
準備預金残	1,391,700	1,381,000	1,389,000	1,365,000	1,375,600	1,379,600
レート	0.067%	0.074%	0.070%	0.068%	0.070%	0.069%
月中平均	0.06819%	0.06839%	0.06855%	0.06800%	0.06900%	0.06900%

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通	10,000億円	9/5	~ 12/12 (98日間)	応札	2,590億円	落札	2,590億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
CP買入	5,500億円	9/8		応札	11,491億円	落札	5,128億円	0.092%	17.7%	平均落札レート	0.094%
国債買入	3,000億円	9/5		応札	10,942億円	落札	3,001億円	0.008%	56.7%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	2,000億円	9/5		応札	9,659億円	落札	2,000億円	0.005%		平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	9/5		応札	13,108億円	落札	4,008億円	0.008%	1.6%	平均利回り較差	0.010%

米ドル資金供給(固定金利方式) 9/5~9/11 (6日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.590%  
 T-Bill3M 応札30兆5,577億円 落札5兆2,545億円(非競争入札:4,854億5,000万円) 9/8~12/8 0.0220% 按分66.8168% 平均0.0204%  
 交付税特会 1兆500億円 9/11~2015/3/10 応札 4兆2,491億円 落札 1兆500億円 0.090% 按分 85.8780% 平均 0.086%

「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