

<<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想	8日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		500	200	2,000
財政		7,400	1,100	▲ 7,000
資金過不足		7,900	1,300	▲ 5,000
貸出			▲ 100	
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			2,600	1,700
99,691			▲ 5,400	▲ 1,400
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			9,100	
CP等買入				5,100
		▲ 100	▲ 800	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488 被災地支援 3,522			▲ 6,100 10,200	
社債等買入			▲ 100	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 100	9,400	5,400
当預増減		7,800	10,700	400

当座預金残高	1,515,200	9/4以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,381,900		19,200
積み終了先	1,164,500	9/5以降の残り所要積立額	
超過準備	1,164,400	積数	16,900
非準預先残高	133,300	1日平均	1,500
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	99.11%	(実績)	64.52% (日数)

9/3のマネタリーベース		2,418,400	
9/3コール	合計	159,722	無担 61,918 有担 97,804
コール前日増減	計	1,352	無担 ▲ 1,321 有担 2,673

9/4の加重平均レート(速報)				9/3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 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.135 (0.069)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.069 ~0.125 (0.097)					0.065 ~0.120 (0.071)		
0.117 (0.117)					0.117 ~0.150 (0.137)		
0.118 ~0.340 (0.127)							
0.118 (0.118)							
0.075 ~0.200 (0.110)		0.08-0.12	-				有担先日付分
		0.08-0.12	-				
		0.08-0.12	0.001-0.005				
		-	-				
		-	-				

<< 9/5の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,525,900	前日比	10,700
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。

<< 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8,000億円増加の116兆9,000億円(当金残高見込みは151兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06%、地銀・信託業態から0.065%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.065~0.066%を中心とした出合いとなった。一巡後は0.061~0.065%での出合いで推移した。ターム物は、2W~1M物の期間で大手行によるまとまった調達が見られた。本日の共通担保資金供給オペは、3M物8,000億円のオファーに対して、応札額1,650億円の札割れとなった。

<< 4日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばい圏での動きとなった。短国市場は売り物に乏しく、現状の水準では購入ニーズも限定的なことから、閑散な地合いとなった。CP市場は、償還総額1,400億円程度に対して発行総額は900億円弱にとどまった。発行レートは総じて横ばい圏での動きとなった。

- << 5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
 - *金融経済月報
 - *米国8月の雇用統計
 - *ユーロ圏4-6月期のGDP改定値
 - *流動性供給入札(3,000億円、9/9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	0.530	0.000	日経平均株価(終値)	15,676.18	▲ 52.17	為替(9時)	104.89-90
						為替(5時)	104.94-95

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	8/29	9/1	9/2	9/3	9/4
日銀当預残	1,525,200	1,520,600	1,497,400	1,506,400	1,507,400	1,515,200
準備預金残	1,381,000	1,389,000	1,365,000	1,375,600	1,379,600	1,381,900
レート	0.074%	0.070%	0.068%	0.070%	0.069%	0.074%
月中平均	0.06839%	0.06855%	0.06800%	0.06900%	0.06900%	0.07025%

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 9/8 ~ 12/8 (91日間) 応札 1,650億円 落札 1,650億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)

<<日銀金融政策決定会合・結果>>
 ・マネタリーベースが、年間約60~70兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(全員一致)
 ・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。
 ①長期国債について、保有残高が年間約50兆円に相当するペースで増加し、平均残存期間が7年程度となるよう買入れを行う。
 ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約1兆円、年間約300億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 ③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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