

<<資金需給>>

単位 億円

	5日需給速報		8日需給予想		9日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		400	1,500	1,000		
財政		1,200	▲ 11,000	▲ 2,000		
資金過不足		1,600	▲ 9,500	▲ 1,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		2,600	1,700			
96,861		▲ 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			
		▲ 800	▲ 700			
貸出支援基金						
(成長) 38,608		▲ 6,100				
(増加) 133,488		10,200				
被災地支援						
3,522						
社債等買入		▲ 100				
ETF買入						
国債補充供給						
小計		9,500	4,700	0		
当増減		11,100	▲ 4,800	▲ 1,000		

当座預金残高	1,526,300	9/5以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,399,400		16,900
積み終了先	1,182,800	9/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,182,800	積数	10,000
非準備先残高	126,900	1日平均	1,300
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	1,907,800		
準備預金進捗率	99.48% (実績)	74.19% (日数)	

9/4のマネタリベース		2,425,700	
9/4コール	合計	158,837 無担	62,160 有担
96,677			
コール前日増減	計	▲ 885 無担	242 有担
			▲ 1,127

9/5の加重平均レート(速報)				9/4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	O/N	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.060	~0.135 (0.070)	0.030	~0.040 (0.031)			0.050	~0.135 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.120	(0.120)					T/N		0.069 ~0.125 (0.097)	
						S/N			
0.071	~0.200 (0.119)					1W		0.117 (0.117)	
0.265	(0.265)					2W		0.118 ~0.340 (0.123)	
0.118	(0.118)					3W		0.118 (0.118)	
				0.08-0.12	-	1M		0.075 ~0.200 (0.114)	有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	▲0.001-▲0.003	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

流動性供給 応札 1兆1,708億円 落札 2,996億円 9/9 募入最大利回較差 0.004% 按分 56.8454% 募入平均利回較差 0.003%

<< 9/8の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,521,500	前日比	▲ 4,800
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。

<< 5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1兆4,000億円増加の118兆3,000億円(当金残高見込みは152兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.065%、地銀・信託業態から0.065~0.068%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.069%を中心とした出合いになった。週末要因により強含んだことで、一巡以降も0.065~0.07%での出合いで推移した。ターム物は、ロール案件の調達を中心となった。

<< 5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。短国市場は全般的に売り気配が見えない中、ショートカバーからか新発3M(477回)が▲0.001~▲0.003%で小額の出合いがみられた程度であった。国庫短期証券買入オベは、マーケットの品薄感や現状の水準が考慮されたせいか、本日の実施は見送られた。CP市場は、償還総額1,000億円程度に対して発行総額は800億円程度となった。発行レートは横ばい圏での動きとなった。

<< 8日の材料 >>

- *4-6月期のGDP2次速報(市場予想：前期比年率▲7.0%)
- *7月の国際収支 *7月の特定サービス産業動態統計速報
- *8月の景気ウォッチャー調査
- *米国7月の消費者信用残高
- *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、9/10発行)

JGB新発10年債	0.535	0.005	日経平均株価(終値)	15,668.68	▲ 7.50	為替(9時)	105.58-60
						為替(5時)	105.24-26

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	8/29	9/1	9/2	9/3	9/4	9/5
日銀当座預金	1,520,600	1,497,400	1,506,400	1,507,400	1,515,200	1,526,300
準備預金残	1,389,000	1,365,000	1,375,600	1,379,600	1,381,900	1,399,400
レート	0.070%	0.068%	0.070%	0.069%	0.074%	0.070%
月中平均	0.06855%	0.06800%	0.06900%	0.06900%	0.07025%	0.07014%

「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