

<<資金需給>>

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,100	300	0
財政		1,500	4,900	▲ 22,000
資金過不足		2,600	5,200	▲ 22,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		9,200		
67,853		▲ 7,200		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		6,000		
国庫短期証売却				
国債買入		4,900	12,100	
CP等買入		5,000		
		▲ 500	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 244,836				
被災地支援				
3,166				
社債等買入			▲ 100	
ETF買入		400	300	
国債補充供給				
小計		17,800	12,100	0
当預増減		20,400	17,300	▲ 22,000

当座預金残高	2,346,600	9/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,137,900		2,100
積み終了先	1,794,400	9/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,794,300	積数	1,500
非準備先残高	208,700	1日平均	200
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)			2,028,900
準備預金進捗率	99.93%	(実績)	77.42% (日数)

9/7のマネタリーベース		3,282,800	
9/7コール合計	203,635	無担	73,108
有担	130,527		
コール前日増減	計	3,981	無担
		3,303	有担
			678

9/8の加重平均レート(速報)			9/7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
0.030 ~0.130 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.080 (0.075)	
0.060 ~0.130 (0.082)				T/N	0.072 ~0.130 (0.085)
0.125 (0.125)				S/N	0.125 (0.125)
0.130 (0.130)				1W	0.117 (0.117)
0.170 (0.170)				2W	
				3W	
		0.08-0.13	-	1M	
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.001	3M	
		-	▲0.016-▲0.002	6M	
		-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

T-Bill6M 応札12兆5,827億円 落札3兆2,018億4,000万円(非競争入札:2,981億円) 9/10~2016/3/10 ▲0.0020% 按分38.8938% 平均▲0.0080%
 30年利付国債(表面利率1.4%) 応札2兆2,663億円 落札7,290億円(I非競争入札:704億円) 9/24~2045/9/20 1.416% 按分57.2545% 平均1.412%

「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。」

<< 9/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,363,900	前日比	17,300
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.075%前後の出合いが中心になると予想される。

<< 8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2兆4,000億円増の179兆7,000億円(当座預金残高見込みは234兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・系統業態から0.073~0.076%での調達、大手行からは0.075%での調達希望でまとまった。一巡後は、まとまった金額の取引を中心に0.075~0.077%での出合いが複数散見された。ターム物は、ロール案件が見られた程度であった。

<< 8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。短国アウトライイト市場は6M物の入札が実施された。W I取引で▲0.016~▲0.015%の出合いが見られたこともあり、平均落札利回りは▲0.008%と強めになったが、按分落札利回りは▲0.002%と概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーは、▲0.002%でまとまった出合いが見られた後は様子見となった。CP市場は10日発行にあたったことで、鉄鋼、ゴム等の業態でまとまった発行が見られ、総額は2,000億円程度に膨らんだ。発行レートは、全体的に横ばい圏でありながらも、低下余地を探る銘柄が散見された。

<< 9日の材料 >>
 *8月のマネーストック
 *8月の消費動向調査
 *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	119.42-45
0.356 ▲ 0.009	17,427.08 ▲ 433.39	為替(5時)	120.15-17

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	9/1	9/2	9/3	9/4	9/7	9/8
日銀当預残	2,323,400	2,320,000	2,314,900	2,332,400	2,326,200	2,346,600
準備預金残	2,112,900	2,110,000	2,104,400	2,123,300	2,119,200	2,137,900
レート	0.076%	0.077%	0.077%	0.076%	0.075%	0.075%
月中平均	0.07600%	0.07650%	0.07667%	0.07633%	0.07614%	0.07600%

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