

<<資金需給>>

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想		11日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		300	▲ 300	▲ 2,000		
財政		4,800	▲ 23,600	1,000		
資金過不足		5,100	▲ 23,900	▲ 1,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					200	
67,853					▲ 5,600	
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		12,100			7,800	
CP等買入						
		▲ 200	▲ 1,000			
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		300		300		
国債補完供給	即日	▲ 200		200		
小計		11,900	▲ 500	2,400		
当増減		17,000	▲ 24,400	1,400		

<< 9/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,339,200	前日比	▲ 24,400
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。

<< 9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1兆4,000億円増の181兆1,000億円(当座預金残高見込みは236兆4,000億円)。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%での調達希望で始まった。一巡後は、0.075~0.077%で散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件が見られた程度であった。3M物の共通担保オペが1兆5,000億円度オフアされ、応札額230億円と、期落ち分の5,550億円を大幅に下回る結果となった。

<< 9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。短国市場は、材料に乏しく取引閑散だった。CP市場はゴム、石油業態からまとまった発行が見られ、発行総額は1,000億円を上回った。発行レートは、参加者の買いニーズが強く、全体的に低下した。

<< 10日の材料 >>

- *7月の機械受注統計(市場予想: 船舶・電力除く民需、前月比+3.7%)
- *8月の企業物価指数
- *MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
- *米国7月の卸売売上高
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、9/14発行)
- *5年利付国債入札(25,000億円、9/24発行)

当座預金残高	2,363,600	9/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,155,000		1,500
積み終了先	1,809,200	9/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,808,500	積数	600
非準預先残高	208,600	1日平均	100
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	99.97%	(実績)	80.65% (日数)

JGB新発10年債	0.360	0.004	日経平均株価(終値)	18,770.51	1,343.43	為替(9時)	120.10-11
						為替(5時)	120.67-69

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	9/2	9/3	9/4	9/7	9/8	9/9
日銀当預残	2,320,000	2,314,900	2,332,400	2,326,200	2,346,600	2,363,600
準備預金残	2,110,000	2,104,400	2,123,300	2,119,200	2,137,900	2,155,000
レート	0.077%	0.077%	0.076%	0.075%	0.075%	0.075%
月中平均	0.07650%	0.07667%	0.07633%	0.07614%	0.07600%	0.07589%

9/8のマネタリーベース				3,302,000		
9/8コール	合計	201,662	無担	73,841	有担	127,821
コール前日増減	計	▲ 1,973	無担	733	有担	▲ 2,706

9/9の加重平均レート(速報)				9/8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	
0.030 ~0.080 (0.075)	0.030	~0.040	(0.031)			0.030 ~0.130 (0.075)		0.030	~0.040 (0.031)
0.050 ~0.120 (0.078)							0.060 ~0.130 (0.082)		
							0.125 (0.125)		
0.070 ~0.340 (0.109)							0.130 (0.130)		
							0.170 (0.170)		
				0.08-0.13	-				有担先日付分
				0.08-0.12	-				
				0.08-0.12	-				
				-	-				
				-	-				
				-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	9/11	~ 12/22 (102日間)	応札	230億円	落札	230億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	4,000億円	9/9	~ 9/10 (1日間)	応札	200億円	落札	200億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	4,000億円	9/11		応札	11,772億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	0.003%	94.5%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,400億円	9/11		応札	8,461億円	落札	2,403億円	按分利回り較差	0.007%	80.2%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	1,400億円	9/11		応札	4,466億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	-0.002%	36.0%	平均利回り較差	0.001%
社債買入	1,000億円	9/15		応札	1,727億円	落札	1,000億円	按分レート	0.073%	58.3%	平均落札レート	0.090%
米ドル資金供給(固定金利方式)		9/11~9/17 (6日間)		応札	400万ドル	落札	400万ドル	貸付利率	0.650%			

「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