

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想	14日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	▲ 300	1,000
財政		▲ 23,700	1,300	▲ 2,000
資金過不足		▲ 24,000	1,000	▲ 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			8,200	
CP等買入				
		▲ 1,000	▲ 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			▲ 400	
ETF買入		300	100	
国債補充供給		200		
小計		▲ 500	1,500	0
当預増減		▲ 24,500	2,500	▲ 1,000

当座預金残高	2,339,100	9/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,132,700		600
積み終了先	1,784,600	9/11以降の残り所要積立額	
超過準備	1,784,600	積数	500
非準備先残高	206,400	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	99.98% (実績)		83.87% (日数)

9/9のマネタリーベース		3,318,700	
9/9コール合計	202,312	無担	72,574
有担	129,738		
コール前日増減	計 650	無担	▲ 1,267
		有担	1,917

9/10の加重平均レート(速報)			9/9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
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.030 ~0.080 (0.075)	
0.072 ~0.120 (0.079)				T/N	0.050 ~0.120 (0.078)
				S/N	
				1W 0.070 (0.070)	0.122 ~0.340 (0.158)
				2W	
				3W	
0.233 (0.233)		0.08-0.13	-	1M	
		0.08-0.12	-	2M	有担先日付分
		0.08-0.12	▲0.006-0.000	3M	
		-	-	6M	
		-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 1,156億円 9/10 ~ 9/11 (1日間) 応札 39億円 落札 39億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 T-Bill3M 応札17兆2,530億円 落札4兆6,236億2,000万円(非競争入札:4,263億円) 9/14~12/14 0.000% 按分8.8270% 平均▲0.0032%
 5年利付国債(表面利率0.1%) 応札7兆9,245億円 落札2兆2,734億円(I非競争入札:2,244億円) 9/24~2020/9/20 0.069%按分63.1297%平均0.067%
 ETF買入 317億円 約定日 9/10

「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

<< 9/11の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,341,600	前日比	2,500
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.07%台後半の出合いが中心になると予想される。

<< 10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2兆6,000億円減の178兆5,000億円(当座預金残高見込みは233兆9,000億円)。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、まとまった金額に対しては0.075~0.077%、それ以外は、0.07~0.073%での出合いが見られるなか本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

<< 10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3M物の入札が実施された。W I取引で▲0.006~▲0.004%とやや強めの出合いがみられたこともあり、平均落札利回りは▲0.0032%となったが、按分落札利回りは0.000%と概ね事前予想通りの結果となった。事前予想通りの結果となったことから、セカンダリーは0.000%の出合いが見られた程度と小動きであった。CP市場は、卸売業、建設業の業態でまとまった発行が見られたものの、発行総額は800億円弱にとどまった。発行レートは、引続き参加者の積極的な買いが見られ、期内物、期越え物ともに低下基調であった。

<< 11日の材料 >>
 *7-9月期の法人企業景気予測調査季報
 *7月のマネタリーサーベイ
 *米国8月の財政収支
 *米国8月の生産者物価指数
 *米国9月のミシガン大消費者信頼感指数速報

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.24-26
0.350 ▲ 0.010	18,299.62 ▲ 470.89	為替(5時)	120.87-89

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	9/3	9/4	9/7	9/8	9/9	9/10
日銀当預残	2,314,900	2,332,400	2,326,200	2,346,600	2,363,600	2,339,100
準備預金残	2,104,400	2,123,300	2,119,200	2,137,900	2,155,000	2,132,700
レート	0.077%	0.076%	0.075%	0.075%	0.075%	0.076%
月中平均	0.07667%	0.07633%	0.07614%	0.07600%	0.07589%	0.07590%