

**<<資金需給>>**

単位 億円

	11日需給速報		14日需給予想		15日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	900	1,000		
財政		1,600	▲ 8,000	▲ 5,000		
資金過不足		1,300	▲ 7,100	▲ 4,000		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		200				
62,533		▲ 5,600				
国債買現		0				
CP買現		0				
国庫短期証買入				15,000		
国庫短期証売却						
国債買入		8,200		8,700		
CP等買入		▲ 1,000	▲ 300			
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		1,000		
ETF買入		100				
国債補充供給						
小計		1,500	▲ 300	24,700		
当預増減		2,800	▲ 7,400	20,700		

当座預金残高	2,341,900	9/11以降の残り所要積立額	500
準備預金残高	2,136,200		
積み終了先	1,790,800	9/14以降の残り所要積立額	100
超過準備	1,790,800	積数	100
非準備先残高	205,700	1日平均	0
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	100.00% (実績)	93.55% (日数)	

9/10のマネタリーベース		3,294,600	
9/10コール	合計	201,662	無担 70,517 有担 131,145
コール前日増減	計	▲ 650	無担 ▲ 2,057 有担 1,407

9/11の加重平均レート(速報)				9/10の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.030 ~0.125 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)		O/N	0.060 ~0.125 (0.076)		
0.030 ~0.120 (0.075)				T/N		0.030 ~0.120 (0.075)	
				S/N			
				1W			
0.200 ~0.310 (0.218)				2W			
				3W			
0.075 (0.075)				1M	0.233	(0.233)	有担先日付分
				2M			
				3M			
				6M			
				1Y			

9/14の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,334,500	前日比	▲ 7,400
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。					

<< 11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9,000億円増の179兆4,000億円(当座預金残高見込みは234兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・系統業態から0.073~0.078%での調達、大手行からは0.075%での調達希望で始まった。週末要因によりビッド水準は底堅く、一巡後も0.073~0.079%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。

<< 11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、短国買入オペが前回比9,000億円増額の15,000億円でおfferされた。予想外に多いoffer額となったため、平均落札利回較差▲0.001%、按分利回較差▲0.004%とやや強めの結果となった。これを受け、後場は6Mが▲0.007%、3Mが▲0.003%で出合うなど、強含みの展開となった。CP市場は償還総額2,000億程度に対し、発行総額は1,000億円程度にとどまった。引続き、参加者の買いニーズが強い状況が続いており、発行レートは低下した。

<< 14日の材料 >>  
 \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、15日まで)  
 \*7月の第3次産業活動指数  
 \*7月の石油等消費動向統計

JGB新発10年債	0.345	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	18,264.22	▲ 35.40	為替(9時)	120.64-66
						為替(5時)	120.56-57

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	9/4	9/7	9/8	9/9	9/10	9/11
日銀当預残	2,332,400	2,326,200	2,346,600	2,363,600	2,339,100	2,341,900
準備預金残	2,123,300	2,119,200	2,137,900	2,155,000	2,132,700	2,136,200
レート	0.076%	0.075%	0.075%	0.075%	0.076%	0.076%
月平均	0.07633%	0.07614%	0.07600%	0.07589%	0.07590%	0.07592%

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	4,000億円	9/11	~ 9/14 (3日間)	応札	13億円	落札	13億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	15,000億円	9/15		応札	22,938億円	落札	15,002億円	按分利回り較差	-0.004%	59.1%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	700億円	9/15		応札	1,506億円	落札	700億円	按分利回り較差	0.002%	82.3%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	4,000億円	9/15		応札	18,048億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.007%	16.2%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	4,000億円	9/15		応札	13,833億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	-0.002%	23.9%	平均利回り較差	0.000%

「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