

◀資金需給▶

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想		17日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300	▲ 1,500	▲ 2,000		
財政		▲ 700	▲ 700	1,000		
資金過不足		▲ 2,000	▲ 2,200	▲ 1,000		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		62,533				
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		8,700				
CP等買入				5,000		
貸出支援基金(成長)		▲ 500	▲ 400			
(成長) 51,505						
(増加) 244,836				▲ 100		
被災地支援						
3,166						
社債等買入		1,000				
ETF買入		200	300			
国債補充供給						
小計		24,400	▲ 100	4,900		
当預増減		22,400	▲ 2,300	3,900		

当座預金残高	2,356,200	9/15以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	2,152,000	9/16以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,801,100	積数	1,952,800
超過準備	1,801,100	1日平均	65,100
非準備先残高	204,200	積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	2,028,900
9月の新所要見込	65,100	(一日平均)	

9/14のマナリーベース		3,289,100	
9/14コール	合計	202,512	無担 67,260 有担 135,252
コール前日増減	計	▲ 641	無担 ▲ 3,000 有担 2,359

9/15の加重平均レート(速報)				9/14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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	有担先日付分	
0.005 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.030 ~0.122 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.030 ~0.120 (0.076)				T/N		0.030 ~0.120 (0.075)		
				S/N		0.130 (0.130)		
0.077 ~0.117 (0.087)				1W		0.081 (0.081)		
0.118 ~0.170 (0.118)				2W		0.076 ~0.340 (0.080)		
				3W				
		0.08-0.13	-	1M		0.150 (0.150)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	-	3M				
		-	▲0.01	6M				
		-	-	1Y				

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完 4,000億円 9/15 ~ 9/16 (1日間) 応札 5億円 落札 5億円 -0.40% 全取 平均 -0.40%(即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 9/17~10/1 (14日間) 応札 5億3,900万ドル 落札 5億3,900万ドル 貸付利率 0.690%

貸出増加支援 9/17~2016/9/16 (365日間) 貸付予定総額 0億円 貸付利率 0.10%

貸出増加支援 9/17~2017/9/15 (729日間) 貸付予定総額 0億円 貸付利率 0.10%

貸出増加支援 9/17~2019/9/17 (1461日間) 貸付予定総額 7,286億円 貸付利率 0.10%

◀◀日銀金融政策決定会合・結果▶▶

- ・マナリーベースが、年間約80兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(賛成8反対1)
- ・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)
 - ①長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。買入れの平均残存期間は7年~10年程度とする。
 - ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約3兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 - ③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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録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

◀ 9/16の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,353,900	前日比	▲ 2,300
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。					

◀ 15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1兆2,000億円増の180兆4,000億円(当座預金残高見込みは235兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・系統・証券業態から0.072~0.077%での調達で始まった。積み最終日であったが、取り急ぎ動きは見られず、一巡後も、同水準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、大手行から2W物0.118%でまとまった調達が見られた。

◀ 15日のオープン市場動向 ▶

短国現先レート、S/Nは前日から横ばい圏の取引であった。短国アウトライト市場は様子見姿勢が強く、終日閑散。6M▲0.01%の小額出合いが見られるにとどまった。CP市場は償還総額800億円程度に対し、ノンバンク業態からの大型案件があり、発行総額は1,000億円程度となった。発行レートは、引き続き低位横ばいで推移した。

◀ 16日の材料 ▶

- *金融経済月報
- *米国FOMC(1日目)
- *米国8月の消費者物価指数
- *ユーロ圏8月の消費者物価指数改定値
- *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、9/24発行)
- *20年利付国債入札(12,000億円、9/24発行)

◀コール8月積み期間分の加重平均レート▶

(土日を含む)	無担	0.07632%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07636%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	0.370	0.015	日経平均株価(終値)	18,026.48	60.78	為替(9時)	120.36-38
						為替(5時)	119.58-60

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	9/8	9/9	9/10	9/11	9/14	9/15
日銀当預残	2,346,600	2,363,600	2,339,100	2,341,900	2,333,800	2,356,200
準備預金残	2,137,900	2,155,000	2,132,700	2,136,200	2,133,700	2,152,000
レート	0.075%	0.075%	0.076%	0.076%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07600%	0.07589%	0.07590%	0.07592%	0.07593%	0.07593%