

◀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		1,400	1,100	0
財政		▲ 11,800	▲ 1,900	▲ 16,000
資金過不足		▲ 10,400	▲ 800	▲ 16,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,700		
97,081		▲ 1,400		
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				9,000
CP等買入		5,100	▲ 200	
		▲ 700		
貸出支援基金(成長) 38,608(増加) 133,488				
被災地支援				
3,522				
社債等買入				
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		4,700	▲ 100	9,000
当預増減		▲ 5,700	▲ 900	▲ 7,000

当座預金残高	1,520,600	9/8以降の残り所要積立額	10,000
準備預金残高	1,384,800	9/9以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,169,000	積数	8,100
超過準備	1,169,000	1日平均	1,200
非準備先残高	135,800	積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	1,907,800
準備預金進捗率	99.58% (実績)		77.42% (日数)

9/5のマネタリーベース		2,436,300	
9/5コール	合計	156,110	無担 59,571 有担 96,539
コール前日増減	計	▲ 2,727	無担 ▲ 2,589 有担 ▲ 138

9/8の加重平均レート(速報)				9/5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	有担当日分	有担先日付分
0.050 ~0.135 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.135 (0.070)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.120 (0.099)				T/N	0.120 (0.120)		
				S/N			
0.075 ~0.400 (0.129)				1W	0.071 ~0.200 (0.119)		
0.175 (0.175)				2W	0.265 (0.265)		
0.120 (0.120)				3W	0.118 (0.118)		
		0.08-0.12	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	-	3M			
		-	0.000-0.015	6M			
		-	-	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債買入	3,000億円	9/10	応札	9,451億円	落札	3,003億円	按分利回り較差	-0.002%	14.8%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	2,000億円	9/10	応札	7,975億円	落札	2,001億円	按分利回り較差	0.001%	83.4%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	9/10	応札	10,023億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	-0.008%	51.4%	平均利回り較差	-0.006%

T-Bill6M 応札16兆4536億円 落札3兆2429億2000万円(非競争入札:2570億円) 9/10~2015/3/10 0.0201% 按分 72.2617% 平均 0.0121%

「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	1,519,700	前日比	▲ 900
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心になると見込まれる。

◀ 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8,000億円減少の117兆5,000億円(当座預金残高見込みは152兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06%、地銀業態から0.063%、信託業態から0.065%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.065%を中心とした出合いになった。一巡以降は0.062~0.065%での出合いで推移した。ターム物は、ロール案件の調達が中心となった。

◀ 8日のオープン市場動向 ▶
 現先S/N物は横ばい圏での推移となった。短国市場は品薄感が強く閑散な状態が続く中、6M物の入札が実施された。W I取引で0.000~0.005%と強めの出合いが見られたものの、落札結果は平均落札利回0.0121%、按分落札利回0.0201%まで流れる結果となった。セカンダリー市場では0.013~0.015%での出合いが見られた。CP市場は、10日にかかる発行となり、石油・鉄鋼業態からのまとまった発行案件が見られ、発行額は3,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなっていた。

◀ 9日の材料 ▶
 *金融政策決定会合議事要旨(8月7,8日分8:50)
 *8月のマネーストック(日銀 8:50)
 *7月の第3次産業活動指数(経済産業省 8:50)
 *8月の消費動向調査(内閣府 14:00)
 *30年利付国債入札(7,000億円、9/22発行)

JGB新発10年債	0.530	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	15,705.11	36.43	為替(9時)	105.17-18
						為替(5時)	105.12-13

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	9/5	9/8
日銀当預残	1,497,400	1,506,400	1,507,400	1,515,200	1,526,300	1,520,600
準備預金残	1,365,000	1,375,600	1,379,600	1,381,900	1,399,400	1,384,800
レート	0.068%	0.070%	0.069%	0.074%	0.070%	0.067%
月中平均	0.06800%	0.06900%	0.06900%	0.07025%	0.07014%	0.06975%

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