

**<<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
銀行券		1,000	600	0
財政		▲ 1,900	▲ 18,500	1,000
資金過不足		▲ 900	▲ 17,900	1,000
貸出				
売出手形				
本店共通				
全店共通				
共通(固定)				
97,081				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				5,000
国庫短期証売却				
国債買入			9,200	
CP等買入				
		▲ 200	▲ 1,000	
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		▲ 100	8,200	5,000
当預増減		▲ 1,000	▲ 9,700	6,000

当座預金残高	1,519,600	9/9以降の残り所要積立額	8,100
準備預金残高	1,388,200		
積み終了先	1,173,300	9/10以降の残り所要積立額	6,100
超過準備	1,173,300	積数	1,000
非準備先残高	131,400	1日平均	1,000
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	99.68% (実績)	80.65% (日数)	

9/8のマネタリーベース		2,429,200	
9/8コール合計	152,637	無担	54,062
コール前日増減	▲ 3,473	有担	98,575
		無担	▲ 5,509
		有担	2,036

9/9の加重平均レート(速報)			9/8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
0.055 ~0.135 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.135 (0.067)	
0.063 ~0.120 (0.086)				T/N	0.065 ~0.120 (0.075)
0.125 (0.125)				S/N	
0.073 ~0.155 (0.089)				1W	0.075 ~0.400 (0.129)
0.115 ~0.330 (0.120)				2W	0.175 (0.175)
				3W	
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	-	3M	0.120 (0.120)
		-	▲0.001 - 0.015	6M	
		-	-	1Y	

**<<オペ情報、入札結果>>**

国短買入 5,000億円 9/11 応札 8,387億円 落札 5,000億円 按分利回り較差 -0.011% 39.5% 平均利回り較差 -0.006%  
 米ドル資金供給(固定金利方式) 9/11~9/18 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.590%  
 30年利付国債(表面利率1.7%) 応札 2兆2,912億円 落札6,423億円( I 非競争入札:571億円) 9/22~2044/9/20 1.687% 按分17.4168% 平均1.679%

「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。」

9/10の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,509,900	前日比	▲ 9,700
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%前後での出会いが中心になると見込まれる。

**<< 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3,000億円減少の117兆2,000億円(当座預金残高見込みは152兆円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06%、地銀・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0.065~0.066%を中心とした出会いとなった。一巡以降は0.06~0.065%での出会いで推移した。ターム物は、2W~1M物の期間で大手行によるまとまった調達が見られた。

**<< 9日のオープン市場動向 >>**  
 短国市場は、国庫短期証券買入オペ5,000億円が実施され、平均利回較差▲0.006%、按分利回較差▲0.011%の結果となった。オペ後は品薄感が一層強まり、全般的に気配が低下した。CP市場は、電機業態からまとまった発行案件が見られたものの、全体的としてみれば発行案件に乏しく、発行額は1,000億程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での取引となった。

**<< 10日の材料 >>**  
 \*岩田日銀副総裁、石川県金融経済懇談会にて講演  
 \*7月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+4.0%)  
 \*8月の企業物価指数  
 \*米国7月の卸売売上高

JGB新発10年債	0.530	0.000	日経平均株価(終値)	15,749.15	44.04	為替(9時)	106.12-13
						為替(5時)	106.31-32

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	9/5	9/8	9/9
日銀当預残	1,506,400	1,507,400	1,515,200	1,526,300	1,520,600	1,519,600
準備預金残	1,375,600	1,379,600	1,381,900	1,399,400	1,384,800	1,388,200
レート	0.070%	0.069%	0.074%	0.070%	0.067%	0.067%
月中平均	0.06900%	0.06900%	0.07025%	0.07014%	0.06975%	0.06944%

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