

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想		12日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		600	▲ 500	▲ 1,000		
財政		▲ 19,100	5,800	0		
資金過不足		▲ 18,500	5,300	▲ 1,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
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		5,300		
CP等買入						
		▲ 1,000	▲ 300			
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						
国債補完供給						
小計		8,200	4,700	5,300		
当預増減		▲ 10,300	10,000	4,300		

当座預金残高	1,509,300	9/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,374,100		6,100
積み終了先	1,160,400	9/11以降の残り所要積立額	
超過準備	1,160,100	積数	4,500
非準預先残高	135,200	1日平均	900
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	99.76% (実績)	83.87% (日数)	

9/9のマネタリーベース		2,427,100	
9/9コール	合計	153,931	無担 54,714 有担 99,217
コール前日増減	計	1,294	無担 652 有担 642

9/10の加重平均レート(速報)				9/9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	O/N	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.055 ~0.135 (0.071)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.135 (0.067)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.066 ~0.135 (0.081)				T/N		0.063 ~0.120 (0.086)		
				S/N		0.125 (0.125)		
0.099 ~0.150 (0.109)				1W		0.073 ~0.155 (0.089)		
0.118 ~0.330 (0.179)				2W		0.115 ~0.330 (0.119)		
0.130 (0.130)				3W				
		0.08-0.12	-	1M		0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.01	3M				
		-	▲0.009-0.001	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

社債買入	1,500億円	9/17	応札	1,739億円	落札	1,501億円	按分レート	0.071%	96.1%	平均落札レート	0.093%
国債買入	4,000億円	9/12	応札	14,137億円	落札	4,009億円	按分利回り較差	-0.003%	16.3%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	1,000億円	9/12	応札	3,712億円	落札	1,006億円	按分利回り較差	0.002%	3.9%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	300億円	9/12	応札	1,038億円	落札	307億円	按分利回り較差	0.003%	60.7%	平均利回り較差	0.004%

「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。」

<< 9/11の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,519,300	前日比	10,000
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。

<< 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6,000億円減少の116兆6,000億円(当座預金残高見込みは151兆円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06%、地銀・信託業態から0.06%台後半の調達希望で始まり、立ち上がりは0.066~0.067%を中心とした出合いとなった。一巡以降は0.06~0.065%で推移した。一部では試し取りと見られる0.12%近辺での調達が行われた。ターム物は、1W~1M物の期間で大手行によるまとまった調達が見られた。

<< 10日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は低位横ばい圏での推移が続いていた。短国市場は品薄感が非常に強く、閑散な状態であった。3M・6Mではマイナスレートでの取引が散見された。CP市場は15日にかかる発行となり、商社・建設・石油業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は1,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは引続き横ばい圏での動きとなっていた。

<< 11日の材料 >>
 *7月のマネタリーサーベイ
 *7-9月期の法人企業景気予測調査季報
 *米国8月の財政収支
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、9/16発行)
 *5年利付国債入札(27,000億円、9/22発行)

JGB新発10年債	0.545	0.015	日経平均株価(終値)	15,788.78	39.63	為替(9時)	106.12-13
						為替(5時)	106.63-64

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	9/5	9/8	9/9	9/10
日銀当預残	1,507,400	1,515,200	1,526,300	1,520,600	1,519,600	1,509,300
準備預金残	1,379,600	1,381,900	1,399,400	1,384,800	1,388,200	1,374,100
レート	0.069%	0.074%	0.070%	0.067%	0.067%	0.071%
月中平均	0.06900%	0.07025%	0.07014%	0.06975%	0.06944%	0.06960%

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