

<<資金需給>>

単位 億円

	18日需給速報		19日需給予想		22日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 1,000	▲ 1,000		▲ 1,000
財政		▲ 100	0	55,000		
資金過不足		▲ 700	▲ 1,000	54,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					2,500	
97,081					▲ 1,600	
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					11,600	
CP等買入					5,400	
		▲ 200	▲ 700			
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053						
被災地支援						
3,522						
社債等買入			▲ 800			
ETF買入						
国債補完供給		100				
小計		▲ 100	▲ 1,500	17,900		
当預増減		▲ 800	▲ 2,500	71,900		

当座預金残高	1,533,600	9/18以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,411,300		418,600
積み終了先	1,156,500	9/19以降の残り所要積立額	
超過準備	1,071,300	積数	274,800
非準預先残高	122,300	1日平均	10,200
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)			1,844,100
準備預金進捗率	85.10%	(実績)	10.00% (日数)

9/17のマナタリーベース				2,440,000
9/17コール	合計	163,610	無担	63,539
			有担	100,071
コール前日増減	計	▲ 288	無担	755
			有担	▲ 1,043

9/18の加重平均レート(速報)			9/17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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.055 ~0.135 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)		0.055 ~0.125 (0.066)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.060 ~0.120 (0.070)				0.060 ~0.120 (0.070)		
0.115 ~0.117 (0.117)				0.110 ~0.150 (0.126)		
0.117 (0.117)						
0.118 ~0.165 (0.121)		0.08-0.12		0.118 ~0.235 (0.120)	有担先日付分	
		0.08-0.12		0.119 (0.119)		
		0.08-0.12	▲0.005-0.00			
		-	-			
		-	▲0.002-▲0.01			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	9/22 ~ 12/22 (91日間)	応札	2,527億円	落札	2,527億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	1,936億円	9/18 ~ 9/19 (1日間)	応札	5億円	落札	5億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	4,000億円	9/22	応札	8,449億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.005%	77.3%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	1,000億円	9/22	応札	2,941億円	落札	1,005億円	按分利回り較差	0.006%	59.3%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	300億円	9/22	応札	1,184億円	落札	302億円	按分利回り較差	0.005%	9.1%	平均利回り較差	0.007%
T-Bill3M	応札28兆4,722億円	落札5兆2,290億4,000万円 (非競争入札: 4,709億円)	9/22~12/22	0.0040%	按分50.5824%	平均0.0016%					

9/19の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,531,100	前日比	▲ 2,500
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られる。

<< 18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4,000億円増の121兆1,000億円(当座預金残高見込みは153兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.063~0.066%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。一巡後は、0.06~0.065%の出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W物0.117%、2W~1M物で0.118%のまとまった調達が見られた。

<< 18日のオープン市場動向 >>
 短国現先S/Nは短国の発行日にあたり、レートは前日から小幅上昇となった。短国アウトライト市場は、3M物の入札が実施され、按分落札利回り0.0040%、平均落札利回り0.0016%、按分比率50.5824%という結果であった。セカンダリーは▲0.005~0.00%の出合い。CP市場は償還総額1,600億円程度に対し、発行総額は2,000億円程度。前日のCP等買入オベの結果を受け、発行レートは小幅低下との印象であった。

<< 19日の材料 >>
 *7月の景気動向指数改訂状況
 *月例経済報告

◀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	0.06923%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06920%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	0.565	0.010	日経平均株価(終値)	16,067.57	178.90	為替(9時)	108.54-55
						為替(5時)	108.54-55

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	9/10	9/11	9/12	9/16	9/17	9/18
日銀当預残	1,509,300	1,518,800	1,521,300	1,504,100	1,534,400	1,533,600
準備預金残	1,374,100	1,386,500	1,390,800	1,374,600	1,405,100	1,411,300
レート	0.071%	0.067%	0.070%	0.067%	0.066%	0.068%
月中平均	0.06960%	0.06936%	0.06953%	0.06938%	0.06918%	0.06911%

「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