

《資金需給》

単位 億円

	18日需給速報		24日需給予想	25日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 4,000	2,200	1,000
財政		3,700	42,800	2,000
資金過不足		▲ 300	45,000	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,300	
62,533			▲ 1,100	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				10,000
国庫短期証売却				
国債買入			8,000	8,200
CP等買入		▲ 1,100	▲ 1,000	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028				
被災地支援				1,000
3,166				▲ 1,000
社債等買入		▲ 900	▲ 100	
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		▲ 2,000	7,200	18,200
当預増減		▲ 2,300	52,200	21,200

当座預金残高	2,357,100	9/18以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,142,400		229,000
積み終了先	1,788,100	9/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,763,400	積数	38,100
非準備先残高	214,700	1日平均	1,700
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)			1,952,800
準備預金進捗率	98.05%	(実績)	26.67% (日数)

9/17のマナターベース				3,321,700
9/17コール	合計	209,799	無担	77,238
			有担	132,561
コール前日増減	計	▲ 13,397	無担	▲ 14,270
			有担	873

9/18の加重平均レート(速報)				9/17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
0.030 ~0.080 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.030 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.125 (0.080)				T/N	0.050 ~0.120 (0.079)		
				S/N			
0.117 (0.117)				1W			
				2W	0.170 (0.170)		
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
0.118 (0.118)		0.08-0.12	▲0.02-▲0.016	3M			
		-	-	6M			
		-	▲0.099-▲0.05	1Y			

《オペ情報、入札結果》

国短買入	10,000億円	9/25	応札	13,490億円	落札	10,002億円	按分利回り較差	0.000%	95.9%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	9/25	応札	14,416億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.005%	82.6%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	9/25	応札	12,588億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.014%	41.1%	平均利回り較差	-0.013%
国債買入	200億円	9/25	応札	834億円	落札	201億円	按分価格較差	-0.200円	78.6%	平均価格較差	-0.273円
ETF買入	317億円	約定日	9/18								

9/24の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,409,300	前日比	52,200
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。

《 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1兆1,000億円減の180兆円(当座預金残高見込みは235兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託・系統・証券業態から0.075~0.079%での調達が始まった。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、ロール案件中心の取引であった。

《 18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で推移した。アウトライト市場は堅調で、3Mで▲0.02~▲0.016%、1Yが▲0.099~▲0.05%の出合いが見られた。短国買入オペが1兆円で通知され、按分利回り較差0.000%、平均利回り較差+0.002%、按分比率95.9%と、無難な結果となった。CP市場は償還総額3,400億円程度に対し、発行総額は2,100億円程度。発行レートは9月末越え物で低下する銘柄が目立った。

《 24日の材料 》
 *米国8月の新築一戸建て販売件数
 *米国8月の耐久財新規受注
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、9/28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	0.330	▲ 0.030	日経平均株価(終値)	18,070.21	▲ 362.06	為替(9時)	120.08-11
						為替(5時)	119.42-44

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	9/11	9/14	9/15	9/16	9/17	9/18
日銀当預残	2,341,900	2,333,800	2,356,200	2,353,900	2,359,400	2,357,100
準備預金残	2,136,200	2,133,700	2,152,000	2,152,600	2,156,500	2,142,400
レート	0.076%	0.076%	0.076%	0.091%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07592%	0.07593%	0.07593%	0.07688%	0.07682%	0.07687%

「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