

《資金需給》

単位 億円

	28日需給速報		29日需給予想		30日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		900		100		▲ 800
財政		2,900		▲ 18,200		700
資金過不足		3,800		▲ 18,100		▲ 100
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		62,701				
国債買現		0				
CP買現		0				
国庫短期証買入				6,000		
国庫短期証売却						
国債買入		8,100				12,000
CP等買入						5,500
		▲ 1,000		▲ 1,400		
貸出支援基金(成長)		51,505				
(増加)		252,028				
被災地支援		3,166				
社債等買入						
ETF買入		100				
国債補完供給	即日	▲ 200		200		
小計		7,000		4,800		17,500
当預増減		10,800		▲ 13,300		17,400

当座預金残高	2,433,100	9/28以降の残り所要積立額	10,200
準備預金残高	2,220,400	9/29以降の残り所要積立額	積数
積み終了先	1,834,500		8,500
超過準備	1,834,500		1日平均
非準備先残高	212,700		500
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)			1,952,400
準備預金進捗率	99.56%	(実績)	43.33% (日数)

9/25のマナリーベース		3,385,600	
9/25コール	合計	209,552	無担 73,044 有担 136,508
コール前日増減	計	▲ 2,285	無担 ▲ 2,713 有担 428

9/28の加重平均レート(速報)				9/25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 ~0.080 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.030)			O/N 0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.130 (0.083)				T/N	0.072 ~0.120 (0.078)		
0.001 ~0.125 (0.010)				S/N			
0.070 ~0.080 (0.076)				1W 0.050 (0.050)	0.071 (0.071)		
				2W	0.145 (0.145)		
				3W			
0.210 (0.210)		0.07-0.12	-	1M	0.065 ~0.145 (0.092)	有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M			
0.600 (0.600)		0.07-0.11	-	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

《オペ情報、入札結果》

国債補完	20,303億円	9/28	~	9/29 (1日間)	応札	142億円	落札	142億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債補完	4,000億円	9/28	~	9/29 (1日間)	応札	33億円	落札	33億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	9/30	応札	10,070億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	0.002%	29.7%	平均利回り較差	0.005%	
国債買入	4,000億円	9/30	応札	14,463億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	0.002%	53.8%	平均利回り較差	0.003%	
国債買入	4,000億円	9/30	応札	18,079億円	落札	4,009億円	按分利回り較差	0.010%	6.9%	平均利回り較差	0.012%	

ETF買入 317億円 約定日 9/28

「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

9/29の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,419,800	前日比	▲ 13,300
O/N	0.07~0.08	T/N	0.03~0.12	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。

《 28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1兆1,000億円増の183兆8,000億円(当座預金残高見込みは243兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託・系統・証券業態から0.07~0.079%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。

《 28日のオープン市場動向 》
現先レートS/Nは前日からやや低下した。短国市場は中間期末を控えて品薄感が強く、閑散とした地合いが続いていた。CP市場は、月末発行となり鉄鋼、建設等の業態からまとまった発行があり、発行総額は7,000億円程度まで膨らんだが、償還総額1兆9,000億円程度と比較して大幅に減少した。発行レートは25日のCP等買入オペの影響もあり、低下した。

《 29日の材料 》
*7月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*米国9月のCB消費者信頼感指数
*2年利付国債入札(25,000億円、10/15発行)

JGB新発10年債	0.345	0.025	日経平均株価(終値)	17,645.11	▲ 235.40	為替(9時)	120.38-40
						為替(5時)	120.27-28

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	9/16	9/17	9/18	9/24	9/25	9/28
日銀当預残	2,353,900	2,359,400	2,357,100	2,403,400	2,422,300	2,433,100
準備預金残	2,152,600	2,156,500	2,142,400	2,196,000	2,210,600	2,220,400
レート	0.091%	0.076%	0.077%	0.076%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07688%	0.07682%	0.07687%	0.07683%	0.07685%	0.07682%