

**<<資金需給>>**

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想	1日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	200	▲ 1,000
財政		▲ 18,400	▲ 7,500	▲ 6,000
資金過不足		▲ 18,300	▲ 7,300	▲ 7,000
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			12,100	
CP等買入			5,500	
		▲ 1,400	▲ 7,100	
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			300	
国債補完供給	即日	▲ 100		
		200	100	
小計		4,700	10,900	0
当増減		▲ 13,600	3,600	▲ 7,000

当座預金残高	2,419,500	9/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,201,900		8,500
積み終了先	1,818,900	9/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,818,700	積数	6,900
非準預先残高	217,600	1日平均	400
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	99.65% (実績)	46.67% (日数)	

9/28のマナターベース		3,395,600	
9/28コール	合計	210,923	無担 74,055 有担 136,868
コール前日増減	計	1,371	無担 1,011 有担 360

9/29の加重平均レート(速報)				9/28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	無担先日分	有担当日分	有担先日分
0.056 ~0.080 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.030)			O/N 0.050 ~0.080 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.030)	
0.001 ~0.130 (0.006)				T/N		0.050 ~0.130 (0.083)	
				S/N		0.001 ~0.150 (0.007)	
0.116 ~0.117 (0.117)				1W		0.070 ~0.080 (0.076)	
0.076 ~0.230 (0.086)				2W			
				3W			
0.118 (0.118)		0.07-0.12	-	1M	0.210 (0.210)		有担先日分
		0.07-0.11	-	2M			
		0.07-0.11	▲0.02-▲0.009	3M	0.600 (0.600)		
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完 8,000億円 9/29 ~ 9/30 (1日間) 応札 67億円 落札 67億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)  
 米ドル資金供給(固定金利方式) 10/1~10/8 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.630%  
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札 8兆5,686億円 落札 2兆3,068億円(I 非競争入札:1,921億円) 10/15~2017/10/15 0.012% 按分29.7246% 平均0.010%  
 ETF買入 317億円 約定日 9/29  
 J-REIT買入 13億円 約定日 9/29

9/30の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,423,100	前日比	3,600
O/N	0.001~0.05	T/N	0.06~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、期末要因により、0.01%を下回る出合いが中心になると予想される。

<< 29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1兆5,000億円減の182兆3,000億円(当座預金残高見込みは242兆円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託・系統・証券業態から0.073~0.079%での調達で始まった。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。

<< 29日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは期を越えたことでやや上昇したものの、低位で推移した。短国市場は3M物で▲0.01~▲0.009%での出合いがみられたものの、閑散であった。CP市場は、商社、機械等の業態からまとまった発行があり、発行総額は3,000億円程度となった。期明けの発行となったものの、投資家のニーズが引き続き強く、発行レートは低位横ばい圏で推移した。

<< 30日の材料 >>  
 \*8月の商業動態統計速報  
 \*8月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+1.0%)  
 \*8月の住宅着工統計  
 \*米国9月のシカゴPM景況感指数  
 \*英国4-6月期のGDP確報値  
 \*ユーロ圏9月の消費者物価指数速報値

JGB新発10年債	0.330	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	16,930.84	▲ 714.27	為替(9時)	119.82-83
						為替(5時)	119.84-86

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	9/17	9/18	9/24	9/25	9/28	9/29
日銀当預残	2,359,400	2,357,100	2,403,400	2,422,300	2,433,100	2,419,500
準備預金残	2,156,500	2,142,400	2,196,000	2,210,600	2,220,400	2,201,900
レート	0.076%	0.077%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%
月平均	0.07682%	0.07687%	0.07683%	0.07685%	0.07682%	0.07679%

「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