

<<資金需給>>

単位 億円

	30日需給速報		1日需給予想	2日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		300	▲ 300	▲ 1,000
財政		▲ 7,900	1,300	▲ 31,000
資金過不足		▲ 7,600	1,000	▲ 32,000
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				
国庫短期証売却				
国債買入		12,100		11,800
CP等買入		5,500		
		▲ 7,100	▲ 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	▲ 400		
		100	400	
小計		10,500	300	11,800
当増増減		2,900	1,300	▲ 20,200

当座預金残高	2,422,400	9/30以降の残り所要積立額	6,900
準備預金残高	2,206,700	10/1以降の残り所要積立額	5,600
積み終了先	1,821,600	積数	400
超過準備	1,821,500	1日平均	1,952,600
非準預先残高	215,700		
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)			
準備預金進捗率	99.71% (実績)	50.00% (日数)	

9/29のマナリーベース		3,381,900	
9/29コール	合計	217,613	無担 79,215 有担 138,398
コール前日増減	計	6,690	無担 5,160 有担 1,530

9/30の加重平均レート(速報)				9/29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
0.001 ~0.075 (0.010)	0.030 (0.030)			O/N 0.056 ~0.080 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.030)	
0.070 ~0.125 (0.080)				T/N	0.001 ~0.130 (0.006)		
				S/N			
0.075 ~0.122 (0.109)				1W	0.116 ~0.117 (0.117)		
0.116 ~0.310 (0.142)				2W	0.076 ~0.230 (0.081)		
0.077 ~0.110 (0.094)				3W			
0.070 (0.070)		0.07~0.12	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.07~0.11	-	2M			
		0.07~0.11	-	3M			
		-	▲0.02-▲0.015	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	47,370億円	9/30	~ 10/1 (1日間)	応札	367億円	落札	367億円	-0.400%	全取	平均	-0.444% (即)	
国債補完	2,351億円	9/30	~ 10/1 (1日間)	応札	26億円	落札	26億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	4,000億円	10/2		応札	13,864億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.007%	80.6%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	4,000億円	10/2		応札	13,381億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	0.004%	59.8%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,400億円	10/2		応札	6,301億円	落札	2,411億円	按分利回り較差	0.010%	54.9%	平均利回り較差	0.011%
国債買入	1,400億円	10/2		応札	6,080億円	落札	1,408億円	按分利回り較差	0.011%	35.0%	平均利回り較差	0.012%

「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。」

<< 10/1の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,423,700	前日比	1,300
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%前後を中心に推移する事が見込まれる。

<< 30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182兆7,000億円(当座預金残高見込みは242兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託・証券業態から0.001~0.003%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、目立った出合いは見られなかった。

<< 30日のオープン市場動向 >>
 短国現先レートS/Nは引き続き品薄であることから低位で推移した。短国市場は6M物が▲0.02~▲0.015%での出合いがみられたものの、閑散小動きであった。CP市場は発行案件が少なく、発行総額は700億円程度となった。発行レートは低位横ばい圏で推移した。

<< 1日の材料 >>
 *9月実績/10月見込み財政資金対民間収支
 *9月調査の日銀短観(概要及び要旨)
 市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(D I) : +13
 *米国8月の建設支出
 *米国9月のISM製造業景況指数
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、48,000億円、10/5発行)
 *10年利付国債入札(24,000億円、10/5発行)

<<コール9月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07457%	有担 0.03090%
(営業日のみ)	無担	0.07337%	有担 0.03084%

JGB新発10年債	0.345	0.015	日経平均株価(終値)	17,388.15	457.31	為替(9時)	119.87-88
						為替(5時)	120.02-04

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	9/18	9/24	9/25	9/28	9/29	9/30
日銀当座預金	2,357,100	2,403,400	2,422,300	2,433,100	2,419,500	2,422,400
準備預金残	2,142,400	2,196,000	2,210,600	2,220,400	2,201,900	2,206,700
レート	0.077%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.010%
月中平均	0.07687%	0.07683%	0.07685%	0.07682%	0.07679%	0.07457%

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