

●資金需給

単位：億円	2017年9月27日	2017年9月28日	2017年9月29日
	需給速報	需給予想	当社予想
銀行券	▲ 600	▲ 1,300	500
財政	▲ 8,900	▲ 8,800	▲ 13,000
資金過不足	▲ 9,500	▲ 10,100	▲ 12,500
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	10,100		8,800
CP等買入		▲ 400	2,500
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			
E T F 買入	500		
国債補完供給		400	
当預増減	700	▲ 10,500	▲ 1,200
当座預金残高	3,714,900	3,704,400	3,703,200
準備預金残高	3,291,900		
積み終了先	3,291,200		9月28日以降の残リ所要積立額
超過準備	3,291,100		積数 11,900
非準備預金先	423,000		1日平均 700
積み期間 (9/16~10/15) の所要準備額			2,911,600
準備預金進捗率	実績	99.59%	日数 40.00%

●短期金融市場関連指標

2017/9/27	無担 (速報)			有担 (速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.078	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.074	0.045	0.020	20,267.05	▲ 63.14	112.38-40	112.68-69
T/N							-	▲ 0.068						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.134						
2W			0.001				-	▲ 0.115						
3W							-	▲ 0.111						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.115	▲ 0.112						
6M							▲ 0.157	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.163	▲ 0.152						
									日付	9/20	9/21	9/22	9/25	9/26
									日銀当預残	3,703,300	3,716,300	3,706,600	3,710,800	3,714,200
									準備預金残	3,277,100	3,292,500	3,288,600	3,294,600	3,295,800
									マネタリーベース	4,754,300	4,768,300	4,759,500	4,763,700	4,767,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.057%	▲ 0.054%	▲ 0.046%	▲ 0.042%	▲ 0.046%
									コール市場残高	97,093	100,448	98,672	99,290	95,588
									うち無担	74,390	77,946	77,288	78,596	74,284
									うちO/N	43,925	46,721	45,283	46,526	43,234
									うち有担	22,703	22,502	21,384	20,694	21,304

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	応募額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●オペ結果

種類	オファー額 (億円・ 百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額 (億円・ 百万ドル)	落札総額 (億円・ 百万ドル)	按分レート ・利回較差 ・価格較差	全取レート ・利回較差 ・価格較差	平均落札レート ・利回較差 ・価格較差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,800	2017/9/29			10,742	2,802	▲0.001		0.000	19.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,000	2017/9/29			12,289	3,005	0.006		0.007	62.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/9/29			7,446	2,005	0.004		0.006	52.3
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/9/29			3,890	1,003	0.004		0.006	8.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	10,000	2017/9/27	2017/9/28		22	22		▲0.500	▲0.500	

●2017年9月28日の予定

*黒田日銀総裁、全国証券大会にて講演	*米国4-6月期のGDP確報値	*国庫短期証券(711回)入札 (3ヶ月、44,000億円、10/2発行) *2年利付国債入札 (22,000億円、10/16発行)
--------------------	-----------------	---

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。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