

**<<資金需給>>**

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想		24日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 4,000	▲ 3,900	1,000		
財政		▲ 100	3,900	50,000		
資金過不足		▲ 4,100	0	51,000		
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						
国庫短期証売却						
国債買入				7,800		
CP等買入		5,000	▲ 1,100			
		▲ 300				
貸出支援基金		7,300				
(成長) 51,505						
(増加) 252,028		▲ 2,300				
被災地支援						
3,166						
社債等買入		▲ 100	▲ 900			
ETF買入						
国債補充供給						
小計		9,600	▲ 2,000	8,000		
当預増減		5,500	▲ 2,000	59,000		

当座預金残高	2,359,400	9/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,156,500		671,300
積み終了先	1,669,500	9/18以降の残り所要積立額	
超過準備	1,364,900	積数	229,000
非準備先残高	202,900	1日平均	8,200
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	88.27%	(実績)	6.67% (日数)

<b>9/16のマナターベース</b>		<b>3,312,100</b>	
9/16コール 合計	223,196	無担	91,508
		有担	131,688
コール前日増減	計	35,086	無担
		37,906	有担
			▲ 2,820

9/17の加重平均レート(速報)				9/16の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.030 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)	CP気配a-1	短国	O/N	0.060 ~0.125 (0.091)	無担先日付分	0.030 ~0.040 (0.031)
0.050 ~0.120 (0.079)				T/N		0.030 ~0.121 (0.074)	
				S/N		0.068 ~0.205 (0.100)	
				1W		0.120 (0.120)	
0.170 (0.170)				2W	0.118 (0.118)		
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.04-▲0.01	3M			
		-	▲0.02	6M			
		-	▲0.07-▲0.033	1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通	8,000億円	9/24 ~ 12/21 (88日間) 応札	1,300億円	落札	1,300億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	4,000億円	9/24 応札	11,255億円	落札	4,003億円	-0.003%	90.5%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	2,400億円	9/24 応札	7,358億円	落札	2,404億円	-0.004%	77.8%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	1,400億円	9/24 応札	5,191億円	落札	1,401億円	-0.009%	42.1%	平均利回り較差	-0.007%
T-Bill3M	応札18兆4,563億円	落札4兆7,036億6,000万円(非競争入札:3,863億円)	9/24~12/21	▲0.0103%	按分40.2646%	平均▲0.0215%			

9/18の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,357,400	前日比	▲ 2,000
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。

**<< 17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1兆3,000億円増の181兆1,000億円(当座預金残高見込みは235兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・系統・証券業態から0.074~0.077%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、目立った出合いが見られなかった。

**<< 17日のオープン市場動向 >>**  
 短国現先レート、S/Nは前日から横ばいで推移した。短国3Mの入札は按分落札レート▲0.0103%(按分比率40.2646%)、平均落札レート▲0.0215%と平均・按分共に過去最低となる強い結果となった。セカンダリーは▲0.04~▲0.01%の出合いが見られた。また、6M物で▲0.02%、1Y物で▲0.07~▲0.033%の出合いが見られた。CP市場は償還総額2,000億円程度に対し、連休明け初日の発行にあたり、ノンバンク、精密機器業態からのまとまった発行案件が見られ、発行総額は2,300億円程度とやや膨らんだ。発行レートは低位横ばいで推移した。

**<< 18日の材料 >>**  
 \*日銀金融政策決定会合議事要旨(8月6、7日開催分)

◀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%

<b>JGB新発10年債</b>	<b>日経平均株価(終値)</b>	<b>為替(9時)</b>	<b>120.54-56</b>
0.360 ▲ 0.005	18,432.27 260.67	為替(5時)	120.93-94

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	9/10	9/11	9/14	9/15	9/16	9/17
日銀当預残	2,339,100	2,341,900	2,333,800	2,356,200	2,353,900	2,359,400
準備預金残	2,132,700	2,136,200	2,133,700	2,152,000	2,152,600	2,156,500
レート	0.076%	0.076%	0.076%	0.076%	0.091%	0.076%
月中平均	0.07590%	0.07592%	0.07593%	0.07593%	0.07688%	0.07682%

「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