

**<<資金需給>>**

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想	26日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 1,300	▲ 1,000
財政		▲ 1,900	1,700	1,000
資金過不足		▲ 2,500	400	0
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		98,018		
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証買入		17,500		
国庫短期証売却				
国債買入		6,100		9,000
CP等買入				
		▲ 300	▲ 1,500	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援		3,522		1,000 ▲ 800
社債等買入			▲ 300	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		23,300	▲ 1,800	9,200
当預増減		20,800	▲ 1,400	9,200

当座預金残高	1,624,500	9/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,500,400		92,700
積み終了先	1,230,600	9/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,230,400	積数	76,700
非準備先残高	124,100	1日平均	3,700
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)			1,844,100
準備預金進捗率	95.84% (実績)	30.00% (日数)	

9/22のマナターベース		2,511,800	
9/22コール合計	173,560	無担	66,485
コール前日増減	計 6,997	有担	107,075
		無担	1,449
		有担	5,548

9/24の加重平均レート(速報)			9/22の加重平均レート(確報)			単位(%)
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
0.055 ~0.135 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.030 ~0.135 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.060 ~0.130 (0.070)				T/N	0.065 ~0.120 (0.073)	
				S/N		
				1W 0.117 (0.117)		
0.103 (0.103)				2W	0.116 ~0.330 (0.124)	
0.116 ~0.117 (0.117)				3W		
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
0.210 (0.210)		0.08-0.12	-	3M		
		-	-	6M		
		-	▲0.010-▲0.012	1Y		

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債買入 3,000億円	9/26	応札 9,373億円	落札 3,003億円	按分利回り較差 -0.001%	23.1%	平均利回り較差 0.000%
国債買入 2,000億円	9/26	応札 7,770億円	落札 2,000億円	全取利回り較差 0.006%		平均利回り較差 0.006%
国債買入 4,000億円	9/26	応札 10,454億円	落札 4,004億円	按分利回り較差 -0.013%	82.3%	平均利回り較差 -0.010%
米ドル資金供給(固定金利方式)	9/26~10/2 (6日間)	応札 2億4,000万ドル	落札 2億4,000万ドル	貸付利率 0.590%		
ETF買入	146億円	約定日 9/24				
J-REIT買入	6億円	約定日 9/24				

「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

9/25の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,623,100	前日比	▲ 1,400
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心になると見込まれる。

**<< 24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、前営業日比1兆5,000億円増の12兆3,000億円(当座預金残高見込みは16兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、信託業態から0.065%、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。一巡後は、0.06%台前半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、大手行から1W物0.117%、2W~1M物で0.118%での調達が見られた。

**<< 24日のオープン市場動向 >>**  
 現先レートは横ばい圏での推移となった。短国市場は売り物が無いため、閑散な状態が続く中、1Y物で▲0.010~▲0.012%の出合いが見られた程度であった。CP市場は、償還額3,100億円程度に対し、鉄鋼業態からのまとまった発行案件が見られたものの、発行額は1,300億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばいでの推移となった。

**<< 25日の材料 >>**  
 \*8月の企業向けサービス価格指数  
 \*米国8月の耐久財新規受注  
 \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、9/29発行)  
 \*流動性供給入札(4,000億円、9/29発行)

JGB新発10年債	0.525	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	16,167.45	▲ 38.45	為替(9時)	108.55-56
						為替(5時)	108.54-56

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	9/19	9/22	9/24
日銀当預残	1,504,100	1,534,400	1,533,600	1,530,400	1,603,700	1,624,500
準備預金残	1,374,600	1,405,100	1,411,300	1,399,800	1,480,500	1,500,400
レート	0.067%	0.066%	0.068%	0.069%	0.065%	0.066%
月中平均	0.06938%	0.06918%	0.06911%	0.06910%	0.06874%	0.06863%