

<<資金需給>>

単位 億円

	26日需給速報		29日需給予想	30日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,500	▲ 100	900
財政		▲ 1,200	▲ 25,500	2,200
資金過不足		▲ 2,700	▲ 25,600	3,100
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				10,000
国庫短期証売却				
国債買入		9,100		1,500
CP等買入				4,500
		▲ 800	▲ 600	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援		1,000		
3,689		▲ 800		
社債等買入		▲ 100		
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		8,300	▲ 500	16,000
当預増減		5,600	▲ 26,100	19,100

当座預金残高	1,627,600	9/26以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,501,000		60,500
積み終了先	1,244,200	9/29以降の残り所要積立額	
超過準備	1,242,100	積数	36,900
非準預先残高	126,600	1日平均	2,200
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	98.00% (実績)	43.33% (日数)	

9/25のマナタリーベース		2,531,700	
9/25コール	合計	183,984	無担 71,978 有担 112,006
コール前日増減	計	8,593	無担 7,177 有担 1,416

9/26の加重平均レート(速報)			9/25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	有担当当日分
0.050 ~0.135 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.135 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.070 ~0.125 (0.112)				T/N	0.060 ~0.120 (0.071)	
0.050 ~0.150 (0.062)				S/N		
0.125 (0.125)				1W	0.100 ~0.130 (0.109)	
0.117 ~0.118 (0.117)				2W		
				3W	0.117 (0.117)	
0.090 (0.090)		0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.005-0.002	3M		
		-	-	6M		
		-	▲0.009-▲0.010	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	9/26	~ 9/29 (3日間)	応札	71億円	落札	71億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	10,000億円	9/30	応札	16,802億円	落札	10,001億円	按分利回り較差	-0.006%	84.6%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	1,000億円	9/30	応札	3,235億円	落札	1,004億円	按分利回り較差	-0.009%	19.0%	平均利回り較差	-0.007%
国債買入	300億円	9/30	応札	1,609億円	落札	302億円	按分利回り較差	-0.022%	15.7%	平均利回り較差	-0.017%
国債買入	200億円	9/30	応札	886億円	落札	201億円	按分価格較差	-0.26円	7.3%	平均価格較差	-0.347円
ETF買入	146億円	約定日	9/26								

<< 9/29の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,601,500	前日比	▲ 26,100
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	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。

<< 26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1兆円増の125兆3,000億円(当座預金残高見込みは162兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、信託業態から0.065~0.068%、大手行からは0.06%での調達で始まった。大手行のビッドが0.06%で入った事から、先週末までの週末に比べてやや弱めの地合いとなり、出合い一巡後は、軟調な展開のなか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。

<< 26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。短国市場は短国買入オペが10,000億円で実施され、平均利回較差▲0.002%、按分利回較差▲0.006%と、買入オペを期待した需給相場がそのまま反映される結果となった。CP発行市場は、月末取引にあたることから幅広い業態から発行が見られ、発行総額は6,200億円弱に膨らんだ。一方で、償還額が2兆2,000億円程度あり、償還超となっているため、投資家の購入意欲は強く、レート水準は全般的に若干低下した。

<< 29日の材料 >>

*米国8月の個人所得・消費支出

JGB新発10年債	0.515	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	16,229.86	▲ 144.28	為替(9時)	108.62-64
						為替(5時)	108.96-98

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	9/19	9/22	9/24	9/25	9/26
日銀当預残	1,533,600	1,530,400	1,603,700	1,624,500	1,622,000	1,627,600
準備預金残	1,411,300	1,399,800	1,480,500	1,500,400	1,497,500	1,501,000
レート	0.068%	0.069%	0.065%	0.066%	0.073%	0.066%
月中平均	0.06911%	0.06910%	0.06874%	0.06863%	0.06880%	0.06850%

「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