

<<資金需給>>

単位 億円

	30日需給速報		1日需給予想 金額	2日当社予想 金額
	即日	金額		
銀行券		700	400	0
財政		4,300	▲ 3,300	▲ 2,000
資金過不足		5,000	▲ 2,900	▲ 2,000
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		1,600	9,100	
CP等買入		4,500		
		▲ 6,900		
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援		3,689		
社債等買入				
ETF買入			100	
国債補完供給	即日	▲ 100		
		300	100	
小計		9,400	9,300	0
当増増減		14,400	6,400	▲ 2,000

<< 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	1,621,600	前日比	6,400
O/N	0.04~0.07	T/N	0.04~0.12	S/N	0.04~0.12

無担O/Nは、0.05~0.065%の出合いが中心になると見込まれる。

<< 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3兆1,000億円増の125兆9,000億円(当座預金残高見込みは161兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.02~0.03%、大手行からは0.01~0.015%での調達が始まった。期末日要因により、朝から軟調な展開となり、一巡後は0.01~0.02%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 >>
 現先レートは玉不足から下限域での推移となった。短国アウトライト市場は全般的に様子見姿勢の中、3Mが▲0.002%、1Mでは0.04%の出合いが見られた程度であった。CP市場は閑散。発行総額は500億円程度にとどまった。発行レートは引き続き低下基調での推移となっていた。

<< 1日の材料 >>
 *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(DI)：+10
 *9月実績/10月見込みの財政資金対民間収支
 *米国8月の建設支出
 *米国9月のISM製造業景況指数
 *ユーロ圏4-6月期のGDP確報値
 *交付税等特別会計借入(10,500億円、10/10借入)

<<コール9月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06710%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06640%	有担 0.03100%

当座預金残高	1,615,200	9/30以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,492,800		31,500
積み終了先	1,245,200	10/1以降の残り所要積立額	
超過準備	1,238,400	積数	25,800
非準備先残高	122,400	1日平均	1,700
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)			1,847,900
準備預金進捗率	98.60% (実績)	50.00% (日数)	

JGB新発10年債	0.525	0.005	日経平均株価(終値)	16,173.52	▲ 137.12	為替(9時)	109.40-41
						為替(5時)	109.41-42

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	9/22	9/24	9/25	9/26	9/29	9/30
日銀当預残	1,603,700	1,624,500	1,622,000	1,627,600	1,600,800	1,615,200
準備預金残	1,480,500	1,500,400	1,497,500	1,501,000	1,477,400	1,492,800
レート	0.065%	0.066%	0.073%	0.066%	0.066%	0.029%
月中平均	0.06874%	0.06863%	0.06880%	0.06850%	0.06841%	0.06710%

9/29のマナタリーベース		2,512,200	
9/29コール	合計	176,453	無担 64,408 有担 112,045
コール前日増減	計	▲ 5,420	無担 ▲ 5,771 有担 351

9/30の加重平均レート(速報)				9/29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	有担先日付分	
0.001 ~0.075 (0.029)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.135 (0.066)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.020 ~0.121 (0.044)					0.020 ~0.125 (0.029)			
0.117 ~0.150 (0.139)					0.055 ~0.400 (0.126)			
0.145 ~0.265 (0.194)					0.145 ~0.170 (0.153)			
					0.150 (0.150)			
0.118 ~0.255 (0.187)		0.08-0.12	0.0400		0.118 ~0.170 (0.120)		有担先日付分	
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	▲0.002					
		-	-					
		-	-					
		-	-					

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 2,000億円 9/30 ~ 10/1 (1日間) 応札 120億円 落札 120億円 -0.400% 全取 平均 -0.408% (即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 10/2~10/9 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.590%
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札16兆747億円落札2兆4,965億円(I非競争入札:2,007億円) 10/15~2016/10/15 0.077%按分72.0159% 平均 0.074%
 ETF買入 146億円 約定日 9/30
 J-REIT買入 6億円 約定日 9/30

「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