

◀資金需給▶

単位 億円

	1日需給速報		2日需給予想	3日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		300	▲ 300	0
財政		▲ 4,500	▲ 11,500	2,000
資金過不足		▲ 4,200	▲ 11,800	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				
国庫短期証売却				
国債買入		9,100		6,100
CP等買入				
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	100	
国債補完供給		100		
小計		9,300	100	6,100
当預増減		5,100	▲ 11,700	8,100

当座預金残高	1,620,300	10/1以降の残り所要積立額	25,800
準備預金残高	1,492,000	10/2以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,242,600	積数	22,500
超過準備	1,242,600	1日平均	1,600
非準備先残高	128,300	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	98.78% (実績)		53.33% (日数)

9/30のマネタリーベース		2,525,900	
9/30コール	合計	178,090	無担 63,661 有担 114,429
コール前日増減	計	1,637	無担 ▲ 747 有担 2,384

10/1の加重平均レート(速報)				9/30の加重平均レート(確報)			
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	単位(%)
0.020 ~0.135 (0.049)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.001 ~0.075 (0.029)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.120 (0.068)				T/N			
				S/N	0.020 ~0.121 (0.044)		
0.117 ~0.125 (0.122)				1W	0.117 ~0.150 (0.139)		
0.118 ~0.255 (0.138)				2W	0.145 ~0.265 (0.194)		
0.118 ~0.143 (0.120)				3W			
0.118 ~0.265 (0.128)		0.08-0.12	0.03-0.04	1M	0.118 ~0.255 (0.187)	有担先日付分	
		0.08-0.12	0.03-0.04	2M			
		0.08-0.12	0.0000	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債買入	1,100億円	10/3	応札	3,774億円	落札	1,101億円	按分利回り較差	0.002%	68.2%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	3,000億円	10/3	応札	7,378億円	落札	3,004億円	按分利回り較差	-0.008%	84.5%	平均利回り較差	-0.007%
国債買入	2,000億円	10/3	応札	6,710億円	落札	2,000億円	全取利回り較差	0.001%		平均利回り較差	0.001%
交付税特会	1兆500億円	10/10~2015/3/13	応札	3兆5,382億円	落札	1兆500億200万円	0.100%	按分	32.8590%	平均	0.096%

◀ 10/2の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,608,600	前日比	▲ 11,700
O/N	0.04~0.06	T/N	0.04~0.12	S/N	0.04~0.12

無担O/Nは0.04~0.06%の出合いが中心になると見込まれる。

◀ 1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、125兆1,000億円(当座預金残高見込みは162兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.045~0.05%、大手行からは0.03%での調達希望で始まった。0.04~0.05%を中心に出合いつつ、一巡後は0.04%近辺での出合いが散見される程度となって本日の取引を終えた。ターム物に関しては、本日も目立った出合いはなく、ロール案件での取引が散見される程度であった。

◀ 1日のオープン市場動向 ▶
 現先レートは、玉が不足している状況下、期初の運用ニーズが強いため、低下した。短国アウトライト市場は2日のTB3M入札を控えて様子見姿勢が強い。1~2M物で0.03-0.04%、3M物で0%の出合いが見られた。CP市場は鉄鋼・電機業態の大型案件が見られたことで、発行総額は2,600億円まで膨らんだ。レートは概ね横ばい圏での推移となっていた。

- ◀ 2日の材料 ▶
- *9月のマネタリーベース
 - *10月の日銀当座預金増減要因見込み
 - *ECB定例理事会(金融政策発表あり)
 - *8月の米製造業新規受注・出荷・在庫
 - *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、10/6発行)
 - *10年利付国債入札(24,000億円、10/6発行)

◀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%

JGB新発10年債	0.525	0.000	日経平均株価(終値)	16,082.25	▲ 91.27	為替(9時)	109.65-67
						為替(5時)	109.84-86

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	9/24	9/25	9/26	9/29	9/30	10/1
日銀当預残	1,624,500	1,622,000	1,627,600	1,600,800	1,615,200	1,620,300
準備預金残	1,500,400	1,497,500	1,501,000	1,477,400	1,492,800	1,492,000
レート	0.066%	0.073%	0.066%	0.066%	0.029%	0.049%
月中平均	0.06863%	0.06880%	0.06850%	0.06841%	0.06710%	0.04900%

「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録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