

<<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	6日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 200	2,000
財政		▲ 11,800	6,700	▲ 39,000
資金過不足		▲ 12,200	6,500	▲ 37,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				3,300
98,018				▲ 2,700
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			6,300	
CP等買入			▲ 200	
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				
小計		100	6,200	600
当預増減		▲ 12,100	12,700	▲ 36,400

当座預金残高	1,608,200	10/2以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,477,400		22,500
積み終了先	1,227,500	10/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,227,500	積数	20,300
非準預先残高	130,800	1日平均	1,600
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	98.90%	(実績)	56.67% (日数)

10/1のマネタリーベース		2,530,600	
10/1コール	合計	175,241	無担 60,010 有担 115,231
コール前日増減	計	▲ 2,849	無担 ▲ 3,651 有担 802

10/2 の加重平均レート(速報)			10/1 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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.040 ~0.135 (0.056)	0.030 ~0.040 (0.031)		0.020 ~0.135 (0.049)	0.050 ~0.120 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.055 ~0.123 (0.060)						
0.175 ~0.250 (0.222)				0.117 ~0.125 (0.122)		
				0.118 ~0.255 (0.138)		
				0.118 ~0.143 (0.120)		
0.118 ~0.255 (0.132)		0.08-0.12	0.120 ~0.265 (0.161)	0.118 ~0.255 (0.125)	有担先日付分	
		0.08-0.12				
		0.08-0.12	▲0.03-0.027	0.120 (0.120)		
		-				
		-				
		-				

<< 10/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,620,900	前日比	12,700
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは、0.06%近辺での出合いが中心になると見込まれる。

<< 2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、123兆5,000億円(当座預金残高見込みは160兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.05~0.06%、大手行からは0.045~0.05%での調達希望で始まった。出合いの中心は0.055%と昨日よりもやや強めの立ち上がりとなった。一巡後は、0.05%近辺での出合いが散見される程度で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中心となった。

<< 2日のオープン市場動向 >>
 現先レートは概ね横ばい水準で推移した。短国アウトライト市場は3M入札が実施された。W I取引において0.025-0.027%で取引が見られていた中、結果は平均落札利回0.0165%、按分落札利回0.0202%と予想より強めの決着となった。セカンダリーではショートカバーにより▲0.03%の出合いも見られた。CP市場は件数が少ない中、鉄鋼業態の大型発行を中心に、発行総額は1,100億円程度となった。発行残高が増加している銘柄ではレート上昇が見られたものの、全般的には動意に乏しくレートは横ばいでの推移となっていた。

<< 3日の材料 >>
 *米国8月の貿易収支
 *米国9月のISM非製造業景況指数 *米国9月の雇用統計
 *交付税特別会計借入(10,500億円、10/16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%

JGB新発10年債	0.520	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	15,661.99	▲ 420.26	為替(9時)	109.01-02
						為替(5時)	108.82-83

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	9/25	9/26	9/29	9/30	10/1	10/2
日銀当預残	1,622,000	1,627,600	1,600,800	1,615,200	1,620,300	1,608,200
準備預金残	1,497,500	1,501,000	1,477,400	1,492,800	1,492,000	1,477,400
レート	0.073%	0.066%	0.066%	0.029%	0.049%	0.056%
月中平均	0.06880%	0.06850%	0.06841%	0.06710%	0.04900%	0.05250%

<<オペ情報、入札結果>>
 全店共通 8,000億円 10/6 ~ 1/5 (91日間) 応札 3,300億円 落札 3,300億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札27兆9,603億円 落札5兆2,647億6,000万円(非競争入札:4,052億円) 10/6~2015/1/13 0.0202%按分78.8623% 平均0.0165%
 10年利付国債(表面利率0.5%) 応札7兆6,402億円落札2兆1,967億円(I 非競争入札:1,990億円) 10/6~2024/9/20 0.517% 按分44.9332% 平均0.516%
 ETF買入 147億円 約定日 10/2
 J-REIT買入 8億円 約定日 10/2

「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