

**<<資金需給>>**

単位 億円

	3日需給速報		6日需給予想	7日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	1,500	2,000
財政		7,900	▲ 38,400	0
資金過不足		7,800	▲ 36,900	2,000
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				35,000
国庫短期証売却				
国債買入		6,300		5,300
CP等買入				
		▲ 200	▲ 300	
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	
国債補充供給				
小計		6,200	400	40,300
当預増減		14,000	▲ 36,500	42,300

当座預金残高	1,622,200	10/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,498,000		20,300
積み終了先	1,247,000	10/6以降の残り所要積立額	
超過準備	1,246,800	積数	14,100
非準預先残高	124,200	1日平均	1,400
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	99.24%	(実績)	66.67% (日数)

10/2のマナタリーベース		2,518,900	
10/2コール	合計	173,345	無担 63,099 有担 110,246
コール前日増減	計	▲ 1,896	無担 3,089 有担 ▲ 4,985

10/3の加重平均レート(速報)				10/2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	
0.045 ~0.135 (0.061)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.040 ~0.135 (0.056)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.120 (0.068)					0.055 ~0.123 (0.060)			
0.330 (0.330)								
					0.175 ~0.250 (0.222)			
0.090 ~0.250 (0.134)		0.08-0.12	-		0.118 ~0.255 (0.132)		有担先日付分	
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	▲0.015- ▲0.007					
		-	-					
		-	-					
		-	-					

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	5,774億円	10/3	~ 10/6 (3日間)	応札	28億円	落札	28億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	35,000億円	10/7		応札	39,389億円	落札	35,002億円	-0.009%	3.9%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	4,000億円	10/7		応札	12,554億円	落札	4,005億円	0.001%	44.1%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	1,000億円	10/7		応札	3,511億円	落札	1,009億円	0.002%	7.1%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	300億円	10/7		応札	1,613億円	落札	303億円	0.000%	28.4%	平均利回り較差	0.001%
交付税特会	1兆500億円	10/16~2015/4/16		応札	3兆6,955億円	落札	1兆500億円	0.097%	按分31.6667%	平均	0.095%
ETF買入	147億円	約定日	10/3								

<< 10/6の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,585,700	前日比	▲ 36,500
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となると見込まれる。

**<< 3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、124兆6,000億円(当座預金残高見込みは162兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀・信託業態から0.055~0.06%、大手行からは0.05%での調達希望で始まった。出合いの中心は0.058~0.06%と昨日よりもやや強めの立ち上がりとなった。一巡後は、調達レートが若干低下し、0.05%での出合いが数件見られる程度で今週の取引を終えた。ターム物に関しては、本日もロール案件での出合いが散見される程度であった。

**<< 3日のオープン市場動向 >>**  
 現先レートは前日比横ばい圏での推移となった。短国アウトライト市場は短国買入オペがオファーされた。オファー額が35,000億円と事前予想を上回ったことで、平均利回較差▲0.003%、按分利回較差▲0.009%と流れ気味のしつかりとした結果になった。CP市場は石油・通信・電機業態の大型発行が散見されたものの、全体の件数は少なく、発行総額は1,100億円程度にとどまった。発行残高の多い銘柄ではレートの上昇がみられた。

**<< 6日の材料 >>**  
 \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、7日まで)  
 \*米国FRB労働市場情勢指数(LMCI)

<<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	0.000	日経平均株価(終値)	15,708.65	46.66	為替(9時)	108.51-52
						為替(5時)	108.75-77

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	9/26	9/29	9/30	10/1	10/2	10/3
日銀当預残	1,627,600	1,600,800	1,615,200	1,620,300	1,608,200	1,622,200
準備預金残	1,501,000	1,477,400	1,492,800	1,492,000	1,477,400	1,498,000
レート	0.066%	0.066%	0.029%	0.049%	0.056%	0.061%
月中平均	0.06850%	0.06841%	0.06710%	0.04900%	0.05250%	0.05760%

「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