

**《資金需給》**

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		500	▲ 700	▲ 1,000
財政		▲ 2,500	100	4,000
資金過不足		▲ 2,000	▲ 600	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
98,648				
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				
CP等買入				
		▲ 700	▲ 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		
国債補完供給				
小計		▲ 600	▲ 300	0
当預増減		▲ 2,600	▲ 900	3,000

10/9の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,625,300	前日比	▲ 900
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。

8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、125兆2,000億円(当座預金残高見込みは162兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀・信託業態から0.055~0.058%、大手行からは0.055%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.056~0.058%となった。一巡後は若干調達レートを切り下げ、0.055%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、引き続き調達ニーズが限定的であり、ロール案件での出合いが数件見られる程度であった。

8日のオープン市場動向  
 現先レートS/Nは、横ばいで推移した。短国市場は、6M物の入札が実施された。買入オペへの期待感もあり、最高落札利回り0.0040%、平均落札利回り0.0020%、按分率6.5583%という結果となった。アウトライト市場では、3M:▲0.02%、6M:▲0.01~0.00%と低水準な出合いが見られた。CP市場は、ノンバンク・小売業態からまとまった発行が実施され、発行総額は1,500億円程度であった。発行レートは概ね横ばいとなっていた。

9日の材料  
 \*8月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+0.9%)  
 \*8月の特定サービス産業動態統計速報  
 \*MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)  
 \*米国FOMC議事要旨(9月16、17日開催分) \*米国8月の卸売売上高  
 \*G20財務省・中央銀行総裁会議(ワシントン)  
 \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、10/14発行)

当座預金残高	1,626,200	10/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,494,500		10,000
積み終了先	1,245,600	10/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,245,600	積数	7,200
非準備先残高	131,700	1日平均	1,000
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,856,200		
準備預金進捗率	99.61% (実績)	76.67% (日数)	

JGB新発10年債	0.500	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	15,595.98	▲ 187.85	為替(9時)	108.06-08
						為替(5時)	108.12-13

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	10/1	10/2	10/3	10/6	10/7	10/8
日銀当預残	1,620,300	1,608,200	1,622,200	1,583,100	1,628,800	1,626,200
準備預金残	1,492,000	1,477,400	1,498,000	1,456,100	1,502,700	1,494,500
レート	0.049%	0.056%	0.061%	0.060%	0.059%	0.059%
月中平均	0.04900%	0.05250%	0.05760%	0.05800%	0.05814%	0.05825%

10/7のマナリーベース		2,537,200	
10/7コール 合計	173,170	無担	61,884
有担	111,286		
コール前日増減 計	964	無担	96
有担	868		

10/8の加重平均レート(速報)				10/7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		
0.030 ~0.135 (0.059)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.045 ~0.135 (0.059)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.060 ~0.120 (0.066)				T/N	0.055 ~0.120 (0.064)			
				S/N				
0.125 ~0.255 (0.144)				1W	0.117 ~0.150 (0.139)			
				2W	0.330 (0.330)			
				3W	0.145 (0.145)			
0.300 (0.300)		0.08-0.12	-	1M	0.118 ~0.250 (0.135)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
0.200 (0.200)		0.08-0.12	▲0.02	3M				
		-	▲0.010~0.000	6M				
		-	-	1Y				

**《オペ情報、入札結果》**

T-Bill6M 応札24兆2,726億円 落札3兆2,307億3,000万円(非競争入札:2,692億円) 10/10~2015/4/10 0.0040% 按分6.5583% 平均0.0020%  
 10年物価連動国債(表面利率0.1%) 応札1兆562億円 落札4,999億円 10/10~2024/9/10 ▲0.658% 按分81.6000%  
 ETF買入 147億円 約定日10/8  
 J-REIT買入 8億円 約定日10/8

「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