

**<<資金需給>>**

単位 億円

	2日需給速報		5日需給予想	6日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	1,300	1,000
財政		▲ 29,700	▲ 32,700	2,000
資金過不足		▲ 30,000	▲ 31,400	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,500	
62,701			▲ 1,800	
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		12,000		4,700
CP等買入				
		▲ 100	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028				
被災地支援				
3,166				
社債等買入				
ETF買入		200		
国債補完供給				
小計		12,100	▲ 700	14,700
当預増減		▲ 17,900	▲ 32,100	17,700

10/5の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,373,600	前日比	▲ 32,100
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.075%前後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、前日比1兆3,000億円減の180兆7,000億円(当座預金残高見込みは240兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態を中心に0.075~0.076%近辺の調達希望で始まった。まとまった金額に対しては昨日と同水準で0.077~0.079%程度での出合いも一部でみられた。一巡後は調達レートが低下し、0.07~0.075%程度の出合いが散見される中で本日の取引を終えた。ターム物については、閑散であった。

<< 2日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は、3M物で▲0.03~▲0.02%の出合いが散見されたものの、動意に乏しく終日閑散であった。短国買入オペが10,000億円で実施され、平均利回較差+0.007%、按分利回較差+0.005%と、特定の銘柄を中心に落札されたと思われる水準となった。CP市場では鉄鋼業態等からまとまった発行があり、発行総額1,200億円程度となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

<< 5日の材料 >>

- \*米国9月のISM非製造業景況指数
- \*米国9月のFRB労働市場情勢指数

<<コール9月の加重平均レート>>

(土日を含む)	無担	0.07457%	有担	0.03090%
(営業日のみ)	無担	0.07337%	有担	0.03084%

当座預金残高	2,405,700	10/2以降の残り所要積立額	4,200
準備預金残高	2,188,000	10/5以降の残り所要積立額	積数
積み終了先	1,808,000	積数	1,800
超過準備	1,808,000	1日平均	200
非準備先残高	217,700	積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,952,600
準備預金進捗率	99.91% (実績)		63.33% (日数)

JGB新発10年債	0.315	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,725.13	2.71	為替(9時)	119.83-85
						為替(5時)	120.06-08

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	9/28	9/29	9/30	10/1	10/2
日銀当預残	2,422,300	2,433,100	2,419,500	2,422,400	2,423,600	2,405,700
準備預金残	2,210,600	2,220,400	2,201,900	2,206,700	2,202,100	2,188,000
レート	0.077%	0.076%	0.076%	0.010%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07685%	0.07682%	0.07679%	0.07457%	0.07600%	0.07600%

10/1のマナターベース			3,386,200			
10/1コール	合計	198,528	無担	65,721	有担	132,807
コール前日増減	計	▲ 5,639	無担	9,802	有担	▲ 15,441

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	短国	無担当日分		無担先日付分	有担当日分	
0.030	~0.080 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)			O/N	0.050	~0.130 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)
0.050	~0.121 (0.080)					T/N		0.050	~0.121 (0.080)	
						S/N				
						1W	0.117	~0.155 (0.119)	0.070	~0.117 (0.097)
						2W		0.160	(0.160)	
0.110	(0.110)					3W				
				0.07-0.12	-	1M	0.245	(0.245)	0.116	~0.170 (0.163)
				0.07-0.11	-	2M				有担先日付分
				0.07-0.11	▲ 0.03-▲ 0.02	3M		0.630	(0.630)	
				-	-	6M				
				-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	10,000億円	10/6	応札	25,214億円	落札	10,002億円	按分利回り較差	0.005%	68.9%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	700億円	10/6	応札	2,070億円	落札	701億円	按分利回り較差	-0.005%	53.4%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	4,000億円	10/6	応札	15,309億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	0.001%	85.4%	平均利回り較差	0.002%

「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