

<<資金需給>>

単位 億円

	5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		1,400	900	0
財政		▲ 31,700	4,500	1,000
資金過不足		▲ 30,300	5,400	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,500		
62,401		▲ 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			4,700	11,800
CP等買入				
		▲ 400	▲ 700	
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			100	
国債補完供給				
小計		▲ 700	14,100	11,800
当増減		▲ 31,000	19,500	12,800

当座預金残高	2,374,700	10/5以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,162,200		1,800
積み終了先	1,782,900	10/6以降の残り所要積立額	
超過準備	1,782,900	積数	900
非準預先残高	212,500	1日平均	100
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	99.95% (実績)	66.67% (日数)	

10/2のマネタリーベース				3,368,600		
10/2コール	合計	191,921	無担	60,588	有担	131,333
コール前日増減	計	▲ 6,607	無担	▲ 5,133	有担	▲ 1,474

10/5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		有担当日分	
0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)				0.030 ~0.080 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.125 (0.079)							0.050 ~0.121 (0.080)		
0.110 (0.110)									
0.340 (0.340)									
							0.110 (0.110)		
				0.07-0.12	-				有担当日分
				0.07-0.11	-				
				0.07-0.11	▲0.026-▲0.02				
				-	-				
				-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	8,000億円	10/5 ~ 10/6 (1日間)	0億円	0億円	按分	平均	(即)
国債買入	4,000億円	10/7 応札	14,011億円 落札	4,000億円	全取利回り較差	0.004%	平均利回り較差 0.004%
国債買入	4,000億円	10/7 応札	13,055億円 落札	4,006億円	按分利回り較差	-0.004%	平均利回り較差 -0.003%
国債買入	2,400億円	10/7 応札	6,852億円 落札	2,411億円	按分利回り較差	-0.014%	平均利回り較差 -0.012%
国債買入	1,400億円	10/7 応札	5,344億円 落札	1,405億円	按分利回り較差	-0.018%	平均利回り較差 -0.016%
J-REIT買入	12億円	約定日 10/5					

<< 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	2,394,200	前日比	19,500
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。					

<< 5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2兆4,000億円減の17兆8,000億円(当座預金残高見込みは237兆4,000億円)。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。先週末に引き続き、まとまった金額に対しては0.077~0.079%程度での出合いも一部で見られた。一巡後は0.07~0.075%前後を中心に散發的に出合う程度で本日の取引を終了した。ターム物については、取引閑散であった。

<< 5日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は低位横ばい圏で推移。短国市場は材料なく閑散。3Mで▲0.026~▲0.02%の出合いが見られた程度であった。CP市場は、一部に大型の発行案件が見られたものの、発行総額は1,000億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏であった。

- << 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8月の貿易収支
 *IMF世界経済見通し発表
 *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、10/13発行)
 *流動性供給入札(3,000億円、10/8発行)
 *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	0.07457%	有担 0.03090%
(営業日のみ)	無担	0.07337%	有担 0.03084%

JGB新発10年債	0.310	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	18,005.49	280.36	為替(9時)	120.03-04
						為替(5時)	120.16-18

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	9/28	9/29	9/30	10/1	10/2	10/5
日銀当預残	2,433,100	2,419,500	2,422,400	2,423,600	2,405,700	2,374,700
準備預金残	2,220,400	2,201,900	2,206,700	2,202,100	2,188,000	2,162,200
レート	0.076%	0.076%	0.010%	0.076%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07682%	0.07679%	0.07457%	0.07600%	0.07600%	0.07620%

「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