

**<<資金需給>>**

単位 億円

	9日需給速報		13日需給予想	14日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,000	1,200	0
財政		▲ 1,400	▲ 55,000	2,000
資金過不足		▲ 2,400	▲ 53,800	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		3,400	600	9,100
65,061		▲ 700	▲ 1,100	▲ 9,100
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				15,000
国庫短期証売却				
国債買入				11,800
CP等買入		4,000		
		▲ 300	▲ 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		6,600	▲ 900	26,800
当預増減		4,200	▲ 54,700	28,800

<< 10/13の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,355,600	前日比	▲ 54,700
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.07~0.08%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 9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1兆3,000億円増の182兆円(当座預金残高見込みは241兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、調達側がやや慎重な立ち上がりを見せたが、一部大手行より0.075%で調達が行われたことで0.075%が下支えとなり、地銀・信託業態を中心とした0.075~0.077%前後での出合いで推移した。一巡後は0.065~0.075%前後の調達で推移し本日の取引を終了した。ターム物については、証券業態によるロール案件中心の取引となった。共通担保オペが3M・1兆5,000億円でオファーされ、結果は9,101億円と期落ち分(9,100億円)とほぼ同額の落札となった。

<< 9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。短国市場は短国買入オペが前回比5,000億円増額の15,000億円で実施され、平均落札利回+0.013%、按分落札利回+0.006%の結果となった。引け間際には、6M物で0.095%の出合いが見られた。CP市場は、発行案件に乏しく閑散、発行総額は200億円程度にとどまった。発行レートは引き続き低位横ばい圏での推移となった。

<< 13日の材料 >>

- \*日銀金融政策決定会合議事要旨(9月14、15日開催分)
- \*新日銀ネット第2段階稼働予定
- \*9月の消費動向調査
- \*米国9月の財政収支
- \*英国9月の消費者物価指数

当座預金残高	2,410,300	10/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,190,100		200
積み終了先	1,811,900	10/13以降の残り所要積立額	
超過準備	1,811,900	積数	0
非準備先残高	220,200	1日平均	0
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,960,800		
準備預金進捗率	100.00% (実績)	90.00% (日数)	

JGB新発10年債	0.320	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	18,438.67	297.50	為替(9時)	119.93-94
						為替(5時)	120.11-12

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	10/2	10/5	10/6	10/7	10/8	10/9
日銀当預残	2,405,700	2,374,700	2,394,700	2,409,100	2,406,100	2,410,300
準備預金残	2,188,000	2,162,200	2,177,800	2,188,200	2,186,700	2,190,100
レート	0.076%	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%	0.075%
月中平均	0.07600%	0.07620%	0.07633%	0.07629%	0.07638%	0.07592%

10/8のマナタリーベース					3,367,300	
10/8コール	合計	197,025	無担	63,460	有担	133,565
コール前日増減	計	▲ 3,117	無担	▲ 1,746	有担	▲ 1,371

10/9の加重平均レート(速報)				10/8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	O/N	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.055 ~ 0.080 (0.075)	0.030 ~ 0.040 (0.031)			0.060 ~ 0.125 (0.077)			0.030 ~ 0.040 (0.031)	
0.072 ~ 0.125 (0.083)					0.020 ~ 0.130 (0.076)			
					0.098 (0.098)			
					0.114 ~ 0.145 (0.130)			
0.145 (0.145)		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.004-▲0.003	3M				
		-	▲0.095	6M				
		-	-	1Y				

<< オペ情報、入札結果 >>

全店共通	15,000億円	10/14	~ 1/22 (100日間)	応札	9,101億円	落札	9,101億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国短買入	15,000億円	10/14		応札	29,231億円	落札	15,002億円	0.006%	43.7%	平均利回り較差	0.013%
国債買入	4,000億円	10/14		応札	13,950億円	落札	4,003億円	0.006%	55.5%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	10/14		応札	12,712億円	落札	4,007億円	0.000%	25.4%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	2,400億円	10/14		応札	7,473億円	落札	2,402億円	-0.008%	50.3%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	1,400億円	10/14		応札	5,198億円	落札	1,403億円	-0.008%		平均利回り較差	-0.005%

「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