

**<<資金需給>>**

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想		14日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	▲ 1,200		▲ 1,000	
財政		400	2,800		▲ 16,000	
資金過不足		▲ 500	1,600		▲ 15,000	
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					1,500	
98,648					▲ 2,800	
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					5,300	
CP等買入						
		▲ 300	▲ 900			
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			▲ 100			
ETF買入						
国債補完供給						
小計		▲ 300	▲ 1,000		4,000	
当預増減		▲ 800	600		▲ 11,000	

当座預金残高	1,625,400	10/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,494,000		7,200
積み終了先	1,245,700	10/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,245,600	積数	5,100
非準預先残高	131,400	1日平均	800
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	99.73% (実績)	80.00% (日数)	

10/8のマナタリーベース				2,534,100
10/8コール	合計	171,784	無担	62,312
			有担	109,472
コール前日増減	計	▲ 1,386	無担	428
			有担	▲ 1,814

10/9の加重平均レート(速報)				10/8の加重平均レート(確報)			
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 (0.059)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.030 ~0.135 (0.059)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.120 (0.079)					0.060 ~0.120 (0.066)		
0.340 (0.340)					0.125 ~0.255 (0.144)		
0.330 (0.330)							
0.116 ~0.145 (0.127)		0.08-0.12	-	1M	0.300 (0.300)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.01~0.002	3M	0.200 ~0.245 (0.218)		
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<< 10/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,626,000	前日比	600
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、124兆8,000億円(当座預金残高見込みは162兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは信託業態から0.056~0.058%、地銀業態から0.056%、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、0.055~0.056%での出合いが数件みられる程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、昨日と同様、ロール案件での取引が中心となった。

**<< 9日のオープン市場動向 >>**  
 現先レートS/Nは、引き続き低位で推移した。短国市場は、3M物の入札が実施された。WI取引で出合いが見られない中、最高落札利回り0.0056%、按分率29.2981%、平均落札利回り0.0030%と強めの結果となった。アウトライトは、3M:▲0.01~0.002%での出合いが見られた。CP市場は、鉄鋼・電機業態からまとまった発行が実施されたことで、発行総額は2,100億円程度となった。また、本日はCP等買入オペが実施された。結果は、最高落札利回り0.088%、按分率85.9%、平均落札利回り0.090%と前回比で上昇した。

- << 10日の材料 >>**
- \*日銀金融政策決定会合議事要旨 (9月3、4日開催分)
  - \*8月の第3次産業活動指数 \*9月の消費動向調査
  - \*米国9月の財政収支
  - \*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(2ヶ月、25,000億円、10/15発行)
  - \*流動性供給入札(3,000億円、10/15発行)

JGB新発10年債	0.485	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	15,478.93	▲ 117.05	為替(9時)	108.15-16
						為替(5時)	107.63-65

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	10/3	10/6	10/7	10/8	10/9
日銀当預残	1,608,200	1,622,200	1,583,100	1,628,800	1,626,200	1,625,400
準備預金残	1,477,400	1,498,000	1,456,100	1,502,700	1,494,500	1,494,000
レート	0.056%	0.061%	0.060%	0.059%	0.059%	0.059%
月中平均	0.05250%	0.05760%	0.05800%	0.05814%	0.05825%	0.05833%

**<< オペ情報、入札結果 >>**

全店共通	8,000億円	10/14	~ 1/13 (91日間)	応札	1,541億円	落札	1,541億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
CP買入	4,000億円	10/15		応札	9,237億円	落札	3,592億円	按分レート	0.088%	85.9%	平均落札レート	0.090%
国債買入	4,000億円	10/14		応札	10,803億円	落札	4,010億円	按分利回り較差	-0.014%	11.8%	平均利回り較差	-0.012%
国債買入	1,000億円	10/14		応札	2,889億円	落札	1,002億円	按分利回り較差	-0.013%	17.0%	平均利回り較差	-0.011%
国債買入	300億円	10/14		応札	1,742億円	落札	301億円	按分利回り較差	-0.014%	91.5%	平均利回り較差	-0.013%

T-Bill3M 応札29兆7,997億円 落札5兆1,931億9,000万円(非競争入札:4,567億円) 10/14~2015/1/19 0.0056% 按分29.2981% 平均0.0030%

ETF買入 147億円 約定日 10/9

「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