

《資金需給》

単位 億円

	25日需給速報		26日需給予想	29日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,100	▲ 1,300	1,000
財政		400	▲ 900	▲ 26,000
資金過不足		▲ 700	▲ 2,200	▲ 25,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
98,018				
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			9,100	
CP等買入		▲ 1,500	▲ 800	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援			1,000	
3,522			▲ 800	
社債等買入		▲ 300	▲ 100	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 1,800	8,400	0
当預増減		▲ 2,500	6,200	▲ 25,000

当座預金残高	1,622,000	9/25以降の残り所要積立額	76,700
準備預金残高	1,497,500	9/26以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,229,600	積数	60,500
超過準備	1,229,300	1日平均	3,000
非準備先残高	124,500	積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,844,100
準備預金進捗率	96.72% (実績)		33.33% (日数)

9/24のマネタリーベース		2,533,100	
9/24コール	合計	175,391	無担 64,801 有担 110,590
コール前日増減	計	1,831	無担 ▲ 1,684 有担 3,515

9/25の加重平均レート(速報)				9/24の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.055 ~ 0.135 (0.073)	0.030 ~ 0.040 (0.031)			0.055 ~ 0.135 (0.066)		0.060 ~ 0.130 (0.070)		0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.060 ~ 0.120 (0.071)								
0.100 (0.100)								
0.117 (0.117)						0.103 (0.103)		
0.118 (0.118)						0.116 ~ 0.117 (0.117)		
		0.08-0.12	-			0.118 (0.118)		有担先日付分
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	0.000-0.009			0.210 (0.210)		
		-	-					
		-	▲ 0.009					

《オペ情報、入札結果》

CP買入 5,500億円 9/30 応札 8,795億円 落札 4,494億円 按分レート 0.079% 91.7% 平均落札レート 0.085%
 T-Bill3M 応札26兆747億9,000万円 落札5兆3,129億3,000万円(非競争入札:4,170億円) 9/29~2015/1/8 0.0090% 按分96.3964% 平均0.0025%
 流動性供給 応札 1兆2,320億円 落札 3,993億円 9/29 募入最大利回較差 ▲0.003% 按分 26.7950% 募入平均利回較差 ▲0.007%

「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

9/26の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,628,200	前日比	6,200
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心になると見られる。

《 25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、昨日と同額の124兆3,000億円(当座預金残高見込みは162兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、信託業態から0.065%、大手行からは0.06%での調達で始まった。出合い一巡後に、一部邦銀から0.125%の試し取りと思われる調達が見られたものの、その後は0.06%台前半で散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W物0.117%、2W~1M物で0.118%での調達が見られた。

《 25日のオープン市場動向 》
 現先レートは横ばい圏での推移となった。短国市場は3M物の入札が実施された。W I取引で0.000%の出合いが見られる中、落札結果は平均落札利回0.0025%、最高落札利回0.0090%と引き続き低水準での決着となった。セカンドラリーは0.002~0.004%の出合い。CP市場は、償還額4,000億円程度に対し、機械・自動車業態からのまとまった発行案件が見られたものの、発行額は2,900億円程度にとどまった。発行レートは小幅低下となった。本日はCP等買入オペが5,500億円を実施された。発行市場の落ち着きを反映し、按分利回りは横ばいの0.079%、平均利回りは0.2BP低下の0.085%となった。

《 26日の材料 》
 *8月全国・9月都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想: 全 国(8月)前年同月比(除く生鮮): +3.2%
 東京都区部(9月)前年同月比(除く生鮮): +2.6%
 *米国4-6月期のGDP確報値

JGB新発10年債	0.520	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	16,374.14	206.69	為替(9時)	109.33-34
						為替(5時)	109.33-35

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	9/17	9/18	9/19	9/22	9/24	9/25
日銀当預残	1,534,400	1,533,600	1,530,400	1,603,700	1,624,500	1,622,000
準備預金残	1,405,100	1,411,300	1,399,800	1,480,500	1,500,400	1,497,500
レート	0.066%	0.068%	0.069%	0.065%	0.066%	0.073%
月中平均	0.06918%	0.06911%	0.06910%	0.06874%	0.06863%	0.06880%