

◀資金需給▶

単位 億円

	14日需給速報		15日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,000	1,300	0
財政		▲ 23,200	42,700	1,000
資金過不足		▲ 22,200	44,000	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		
97,428		▲ 2,800		
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証買入				35,000
国庫短期証売却				
国債買入		5,700		9,000
CP等買入			3,600	
		▲ 300	▲ 600	
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				
ETF買入				
国債補充供給	即日	▲ 200	200	
小計		3,900	3,200	44,000
当増減		▲ 18,300	47,200	45,000

当座預金残高	1,608,100	10/14以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,484,200		100
積み終了先	1,235,400	10/15以降の残り所要積立額	
超過準備	1,235,400	積数	100
非準備先残高	123,900	1日平均	100
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)			1,856,300
準備預金進捗率	99.99% (実績)	96.67% (日数)	

10/10のマネタリーベース		2,536,300	
10/10コール	合計	165,383	無担 58,829 有担 106,554
コール前日増減	計	▲ 2,245	無担 ▲ 1,047 有担 ▲ 1,198

10/14の加重平均レート(速報)			10/10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
0.045 ~0.135 (0.060)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.030 ~0.135 (0.060)	
0.060 ~0.120 (0.097)				T/N	0.062 ~0.120 (0.085)
				S/N	
0.075 ~0.150 (0.097)				1W	0.093 ~0.400 (0.140)
0.118 ~0.160 (0.143)				2W	0.160 (0.160)
				3W	
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.070 ~0.300 (0.089)
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.015~▲0.013	3M	
		-	▲0.005~▲0.003	6M	
		-	-	1Y	

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	2,000億円	10/14	~ 10/15 (1日間) 応札	195億円	落札	195億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	35,000億円	10/16	応札	53,258億円	落札	35,003億円	按分利回り較差	-0.005%	1.1%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	3,000億円	10/16	応札	7,978億円	落札	3,001億円	按分利回り較差	-0.004%	0.6%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	2,000億円	10/16	応札	6,650億円	落札	2,006億円	按分利回り較差	-0.004%	4.0%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	4,000億円	10/16	応札	15,313億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	-0.009%	40.5%	平均利回り較差	-0.008%

ETF買入 147億円 約定日 10/14

J-REIT買入 8億円 約定日 10/14

◀ 10/15の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,655,300	前日比	47,200
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。

◀ 14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、122兆4,000億円(当座預金残高見込みは160兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは信託業態から0.057~0.058%、地銀業態から0.056~0.057%、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0.058%となった。一巡後は0.056~0.057%の出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1M物0.118%で調達を行った。

◀ 14日のオープン市場動向 ▶

現先取引S/Nは短国買入オペのアナウンスを契機に低下した。短国市場は3M物で▲0.015~▲0.013%の出合いが見られる中、短国買入オペが前回同様35,000億円で行われた。落札結果は、按分利回り較差こそ▲0.005%となったものの、平均利回り較差は±0.000%となり、確実に売却したいというニーズを反映した結果となった。市場予想通りのオファー額であったため、オペアナウンス後も3M▲0.015%の出合いが散見されるなど、落ち着いた地合いであった。CP発行市場は案件数少なく、発行総額は600億円弱にとどまり、レート水準は概ね横ばいであった。

◀ 15日の材料 ▶

- \*8月のマネタリーサーベイ \*8月の石油等消費動態統計
- \*米国ページブック
- \*ECB定例理事会(金融政策発表なし)
- \*米国8月の企業在庫 \*米国9月の生産者物価指数 \*米国9月の小売売上高
- \*国庫短期証券入札(1年、25,000億円、10/20発行)
- \*30年利付国債入札(7,000億円、10/17発行)

JGB新発10年債	0.495	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	14,936.51	▲ 364.04	為替(9時)	107.05-07
						為替(5時)	107.24-26

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	10/6	10/7	10/8	10/9	10/10	10/14
日銀当預残	1,583,100	1,628,800	1,626,200	1,625,400	1,626,400	1,608,100
準備預金残	1,456,100	1,502,700	1,494,500	1,494,000	1,489,300	1,484,200
レート	0.060%	0.059%	0.059%	0.059%	0.060%	0.060%
月中平均	0.05800%	0.05814%	0.05825%	0.05833%	0.05885%	0.05893%

「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