

<<資金需給>>

単位 億円

	16日需給速報		17日需給予想	20日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 500	▲ 1,300	1,000
財政		2,100	▲ 2,000	▲ 39,000
資金過不足		1,600	▲ 3,300	▲ 38,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				1,700
97,428				▲ 4,000
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		9,200		2,400
CP等買入				
		▲ 200	▲ 400	
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			100	
国債補充供給	即日	▲ 200	200	
小計		43,800	▲ 200	100
当増減		45,400	▲ 3,500	▲ 37,900

当座預金残高	1,699,800	10/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,554,000		1,920,500
積み終了先	438,000	10/17以降の残り所要積立額	
超過準備	333,200	積数	973,700
非準備先残高	145,800	1日平均	32,500
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			1,920,500
準備預金進捗率	49.30%	(実績)	3.23% (日数)

10/15のマナタリーベース		2,562,200	
10/15コール	合計	165,553	無担 56,912 有担 108,641
コール前日増減	計	▲ 655	無担 ▲ 754 有担 99

10/16の加重平均レート(速報)				10/15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		無担先日付分	有担当日分
0.030 ~0.135 (0.058)		0.030	~0.040 (0.031)			0.045 ~0.135 (0.061)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.065 ~0.120 (0.084)							0.060 ~0.120 (0.077)		
							0.125 (0.125)		
0.114 ~0.240 (0.156)						1W 0.155 (0.155)	0.117 (0.117)		
0.118 (0.118)						2W	0.118 ~0.175 (0.119)		
						3W	0.118 (0.118)		
0.118 ~0.630 (0.146)				0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)		有担先日付分
				0.08-0.12	0.0100	2M			
				0.08-0.12	▲0.015-0.0018	3M			
				-	▲0.005	6M			
				-	▲0.015	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	10/20	~ 1/19 (91日間)	応札	1,661億円	落札	1,661億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	3,324億円	10/16	~ 10/17 (1日間)	応札	162億円	落札	162億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	1,100億円	10/20		応札	2,153億円	落札	1,102億円	按分利回り較差	0.006%	99.1%	平均利回り較差	0.010%
国債買入	1,000億円	10/20		応札	3,354億円	落札	1,005億円	按分利回り較差	-0.008%	46.6%	平均利回り較差	-0.007%
国債買入	300億円	10/20		応札	1,028億円	落札	304億円	按分利回り較差	0.005%	44.6%	平均利回り較差	0.006%
T-Bill3M	応札32兆8,430億円	落札5兆2,694億4,000万円(非競争入札:4,705億円)	10/20~2015/1/26	0.0018%	按分50.7603%	平均0.0014%						
交付税特会	1兆500億円	10/24~2015/4/23	応札3兆3,695億円	落札1兆500億100万円	0.094%	按分89.9747%	平均0.092%					
ETF買入	147億円	約定日	10/16									
J-REIT買入	8億円	約定日	10/16									

「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。」

<< 10/17の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,696,300	前日比	▲ 3,500
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。

<< 16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2兆1,000億円増加の129兆1,000億円(当座預金残高見込みは170兆円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.055~0.057%、大手行から0.055%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.055~0.057%となった。一巡後は、0.055~0.057%近辺での出合いが見られた。午後の取引は調整程度で一日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が2Wおよび1M物を0.118%で調達を行った。

<< 16日のオープン市場動向 >>
 現先取引S/Nは昨日ほぼ同水準で推移した。短国市場は3M物の入札が実施され、平均利回り0.0014%、按分利回り0.0018%と0%近辺のしっかりとした結果となった。事前予想通りの落札結果を受け、午後は小動きであった。CP発行市場は20日取引のため鉄鋼・石油業態などからまとまった案件もあり、発行総額は2,600億円程度に膨らんだ。レート水準は概ね横ばい圏であった。

<< 17日の材料 >>
 *黒田日銀総裁、全国信用組合大会にて講演
 *米国9月の住宅着工件数
 *米国10月のミシガン大消費者信頼感指数速報
 *5年利付国債入札(27,000億円、10/21発行)

<<コール9月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06187%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06095%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.485	0.000	日経平均株価(終値)	14,738.38	▲ 335.14	為替(9時)	106.01-02
						為替(5時)	105.91-93

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	10/8	10/9	10/10	10/14	10/15	10/16
日銀当座預金	1,626,200	1,625,400	1,626,400	1,608,100	1,654,400	1,699,800
準備預金残	1,494,500	1,494,000	1,489,300	1,484,200	1,525,800	1,554,000
レート	0.059%	0.059%	0.060%	0.060%	0.061%	0.058%
月中平均	0.05825%	0.05833%	0.05885%	0.05893%	0.05907%	0.05900%

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