

<<資金需給>>

単位 億円

	17日需給速報		20日需給予想		21日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300	300	0		
財政		▲ 2,200	▲ 43,900	▲ 29,000		
資金過不足		▲ 3,500	▲ 43,600	▲ 29,000		
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					26,200	
国庫短期証売却						
国債買入			2,600			
CP等買入						
		▲ 400	▲ 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	▲ 100	900		
ETF買入		100	100			
国債補完供給		200				
小計		▲ 200	▲ 100	27,100		
当預増減		▲ 3,700	▲ 43,700	▲ 1,900		

当座預金残高	1,696,100	10/17以降の残り所要積立額	973,700
準備預金残高	1,560,700		
積み終了先	1,239,500	10/20以降の残り所要積立額	206,900
超過準備	1,032,600	積数	7,700
非準備先残高	135,400	1日平均	7,700
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	89.23% (実績)	12.90% (日数)	

10/16のマナタリーベース		2,608,100	
10/16コール 合計	172,741	無担	65,319
有担	107,422		
コール前日増減	計	7,188	無担
有担	8,407	有担	▲ 1,219

10/17の加重平均レート(速報)				10/16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
0.030 ~0.135 (0.059)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.030 ~0.135 (0.058)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.056 ~0.120 (0.071)				T/N		0.065 ~0.120 (0.084)	
				S/N			
0.117 ~0.140 (0.122)				1W		0.114 ~0.240 (0.156)	
0.118 ~0.340 (0.153)				2W		0.118 (0.118)	
0.116 (0.116)				3W			
0.118 ~0.145 (0.119)		0.08-0.12	-	1M		0.118 ~0.630 (0.146)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.09-▲0.006	3M			
		-	▲0.05-▲0.005	6M			
		-	▲0.05	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	10/17 ~ 10/20 (3日間)	応札	20億円	落札	20億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	30,000億円	10/21	応札	26,220億円	落札	26,220億円	全取利回り較差	-0.097%	平均利回り較差	-0.005%
被災地支援(第42回)	10/24~2015/10/23 (364日間)	貸付予定総額	75億円(大手行 45億円、地域金融機関等 30億円)	貸付利率	0.10%					
5年利付国債(表面利率0.1%)	応札	11兆1,352億円	落札	2兆4,553億円 (I非競争入札:2,420億円)	10/21~2019/9/20	0.138%	按分	25.9722%	平均	0.134%
ETF買入	147億円	約定日	10/17							
J-REIT買入	8億円	約定日	10/17							

「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録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

<< 10/20の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,652,400	前日比	▲ 43,700
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。

<< 17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1兆1,000億円減少の128兆円(当座預金残高見込みは169兆6,000億円)。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0.056~0.057%となった。一巡後は、0.056~0.057%近辺での出合いとなった。午後の取引は調整程度にとどまり、一日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物を0.117%、2Wおよび1M物を0.118%で調達を行っていた。

<< 17日のオープン市場動向 >>
 現先取引S/Nは短国買入オペを契機に低下した。短国市場は30,000億円で短国買入オペが実施され、応札額が26,220億円と札割れの結果となった。全取利回り較差▲0.097%が発表されたことで一旦オファーは姿を消し、午後には3M▲0.09%、6M▲0.05%、1Y▲0.05%の少額出合いが確認された。CP発行市場は案件が数件に限られ、発行総額200億円程度と非常に閑散であった。

<< 20日の材料 >>
 *日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)
 *8月の景気動向指数改訂状況

<<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	0.465	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	14,532.51	▲ 205.87	為替(9時)	106.43-45
						為替(5時)	106.42-43

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	10/9	10/10	10/14	10/15	10/16	10/17
日銀当預残	1,625,400	1,626,400	1,608,100	1,654,400	1,699,800	1,696,100
準備預金残	1,494,000	1,489,300	1,484,200	1,525,800	1,554,000	1,560,700
レート	0.059%	0.060%	0.060%	0.061%	0.058%	0.059%
月中平均	0.05833%	0.05885%	0.05893%	0.05907%	0.05900%	0.05900%