

◀資金需給▶

単位 億円

	20日需給速報		21日需給予想	22日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	▲ 500	▲ 2,000
財政		▲ 44,200	▲ 24,000	2,000
資金過不足		▲ 44,000	▲ 24,500	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,700		
95,098		▲ 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		9,000
CP等買入		▲ 400	▲ 100	
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	900	
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		▲ 100	27,100	9,000
当預増減		▲ 44,100	2,600	9,000
当座預金残高	1,652,000	10/20以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,507,400	206,900		
積み終了先	1,196,300	10/21以降の残り所要積立額		
超過準備	1,189,800	積数		
非準預先残高	144,600	1日平均		
		6,200		
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	91.57%	(実績)	16.13%	(日数)

10/17のマナタリーベース		2,605,700	
10/17コール	合計	175,637	無担 69,027 有担 106,610
コール前日増減	計	2,896	無担 3,708 有担 ▲ 812

10/20の加重平均レート(速報)				10/17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		有担当日分
0.045 ~0.135 (0.060)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.030	
0.055 ~0.120 (0.074)				T/N				
				S/N		0.056 ~0.120 (0.071)		
0.117 ~0.400 (0.136)				1W		0.117 ~0.140 (0.119)		
0.118 ~0.255 (0.136)				2W		0.118 ~0.340 (0.139)		
				3W		0.116 (0.116)		
0.118 ~0.280 (0.121)				1M	0.08-0.12	0.0100	0.118 ~0.145 (0.119)	
				2M	0.08-0.12	-	有担先日付分	
				3M	0.08-0.12	▲0.08		
				6M	-	▲0.05		
				1Y	-	▲0.08		

◀オペ情報、入札結果▶

CP買入	4,000億円	10/23	応札	9,271億円	落札	3,480億円	按分レート	0.086%	56.7%	平均落札レート	0.090%
国債買入	3,000億円	10/22	応札	9,551億円	落札	3,000億円	全取利回り較差	0.012%		平均利回り較差	0.012%
国債買入	2,000億円	10/22	応札	5,675億円	落札	2,003億円	按分利回り較差	0.007%	80.3%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,000億円	10/22	応札	15,617億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	0.012%	38.4%	平均利回り較差	0.012%

「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。」

◀ 10/21の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,654,600	前日比	2,600
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。

◀ 20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、前営業日比4兆2,000億円減少の123兆8,000億円(当座預金残高見込みは165兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.056~0.057%、大手行から0.05~0.055%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%近辺での出合い。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1W物を0.117%、2Wおよび1M物を0.118%で調達を行った。

◀ 20日のオープン市場動向 ▶

現先S/N物は低位横ばい圏での推移となった。短国市場は先週の短国買入オペの影響を受け、売り物なく閑散。3M・6M・1Yでマイナスの出合いが小額見られた程度であった。CP市場はノンバンク業態からまとまった発行案件が見られたものの、発行総額は600億円程度にとどまった。発行レートは横ばい圏での取引となっていた。CP等買入オペが実施され、平均落札利回0.090%・按分落札利回0.086%と按分落札利回は前回比小幅低下の結果となった。

◀ 21日の材料 ▶

- *月例経済報告
- *米国9月の中古住宅販売
- *20年利付国債入札(12,000億円、10/23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		日経平均株価(終値)		為替(9時)		107.16-17
0.485	0.020	15,111.23	578.72	為替(5時)		107.07-08

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	10/10	10/14	10/15	10/16	10/17	10/20
日銀当預残	1,626,400	1,608,100	1,654,400	1,699,800	1,696,100	1,652,000
準備預金残	1,489,300	1,484,200	1,525,800	1,554,000	1,560,700	1,507,400
レート	0.060%	0.060%	0.061%	0.058%	0.059%	0.060%
月中平均	0.05885%	0.05893%	0.05907%	0.05900%	0.05900%	0.05905%

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