

<<資金需給>>

単位 億円

	22日需給速報		23日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,200	▲ 2,000	▲ 2,000
財政		▲ 1,500	▲ 13,500	3,000
資金過不足		▲ 2,700	▲ 15,500	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
95,098				
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		9,200		6,300
CP等買入			3,500	
		▲ 200	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援				100
3,689				▲ 500
社債等買入		▲ 100		
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		9,000	3,500	5,900
当預増減		6,300	▲ 12,000	6,900

当座預金残高	1,660,900	10/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,520,800		123,200
積み終了先	1,226,300	10/23以降の残り所要積立額	
超過準備	1,223,200	積数	95,300
非準備先残高	140,100	1日平均	4,000
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	95.04%	(実績)	22.58% (日数)

10/21のマナタリーベース		2,564,600	
10/21コール合計	183,572	無担	74,474
		有担	109,098
コール前日増減	計	2,669	無担
		2,619	有担
			50

10/22の加重平均レート(速報)				10/21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		
0.045 ~0.135 (0.061)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.045 ~0.135 (0.060)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.056 ~0.120 (0.077)				T/N		0.055 ~0.120 (0.067)		
				S/N				
0.116 ~0.140 (0.131)				1W		0.117 ~0.150 (0.130)		
				2W		0.117 ~0.330 (0.131)		
				3W				
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M		0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.080	3M				
		-	▲0.050	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	3,000億円	10/24	応札	8,500億円	落札	3,011億円	按分利回り較差	0.008%	31.5%	平均利回り較差	0.010%
国債買入	2,000億円	10/24	応札	7,852億円	落札	2,005億円	按分利回り較差	0.002%	12.9%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	1,000億円	10/24	応札	4,552億円	落札	1,003億円	按分利回り較差	0.002%	10.3%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	300億円	10/24	応札	1,545億円	落札	302億円	按分利回り較差	-0.009%	95.6%	平均利回り較差	-0.008%
交付税特会	1兆500億円	10/30~2015/4/30	応札	3兆3,655億円	落札	1兆500億円	0.090%	按分	12.5000%	平均	0.079%

<< 10/23の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,648,900	前日比	▲ 12,000
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。

<< 22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1兆2,000億円増加の125兆6,000億円(当座預金残高見込みは166兆1,000億円)。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0.055~0.057%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。

<< 22日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばい圏での推移となった。短国市場は、動意に乏しい閑散な地合いが続いており、3Mで▲0.080%、6Mで▲0.050%での出合いが見られた程度であった。CP市場は五・十日に係る発行となり、ガス・電機・金融業態からのまとまった発行案件が見られ、発行総額は2,900億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での取引となった。

<< 23日の材料 >>
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、10/27発行)
 *流動性供給入札(4,000億円、10/27発行)

JGB新発10年債	0.480	0.000	日経平均株価(終値)	15,195.77	391.49	為替(9時)	107.02-03
						為替(5時)	106.95-97

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	10/15	10/16	10/17	10/20	10/21	10/22
日銀当預残	1,654,400	1,699,800	1,696,100	1,652,000	1,654,600	1,660,900
準備預金残	1,525,800	1,554,000	1,560,700	1,508,600	1,522,100	1,520,800
レート	0.061%	0.058%	0.059%	0.060%	0.060%	0.061%
月中平均	0.05907%	0.05900%	0.05900%	0.05905%	0.05910%	0.05918%

「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