

◀資金需給▶

単位 億円

	28日需給速報	29日需給予想	30日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 300	▲ 600	▲ 2,000
財政	1,300	▲ 1,700	▲ 1,000
資金過不足	1,000	▲ 2,300	▲ 3,000
貸出			
売出手形	0		
本店共通	0		
全店共通	0		
共通(固定)	10,000		
93,489	▲ 11,700		
国債買現	0		
CP買現	0		
国庫短期証買入	22,500		
国庫短期証売却			
国債買入	10,600	3,100	
CP等買入	▲ 400	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053			
被災地支援	3,255		
社債等買入			
ETF買入	100	200	
国債補充供給			
小計	31,100	3,100	0
当預増減	32,100	800	▲ 3,000

◀ 10/29の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,673,900	前日比	800
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。

◀ 28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3兆円増加の126兆5,000億円(当座預金残高見込みは167兆3,000億円)。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0.057%程度となった。一巡後は、0.055~0.057%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。ターム物については、ロール案件中心の取引となった。

◀ 28日のオープン市場動向 ▶

現先レートS/N物は横ばい圏での動きとなった。短国市場は、3M(489回)が▲0.035~▲0.04%と小幅低下しての出合いがみられたものの、全体的には動意なく閑散であった。CP市場は、償還総額700億円程度に対し、発行総額は大型発行案件が散見されたことで2,000億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなっていた。本日はCP等買入オペが4,000億円実施された。市場での売却ニーズが強い銘柄がオペ対象にあまり入らなかったことから、平均落札利回り0.08%、按分落札利回り0.065%と前回比で大幅に低下した。

◀ 29日の材料 ▶

- *9月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+2.2%)
- *米国FOMC(2日目)

当座預金残高	1,673,100	10/28以降の残り所要積立額	39,600
準備預金残高	1,532,600	10/29以降の残り所要積立額	35,700
積み終了先	1,260,300	積数	2,000
超過準備	1,259,600	1日平均	1,920,500
非準備先残高	140,500		
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			
準備預金進捗率	98.14% (実績)	41.94% (日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	107.85-86
0.460 ▲ 0.010	15,329.91 ▲ 58.81	為替(5時)	107.83-85

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	10/21	10/22	10/23	10/24	10/27	10/28
日銀当預残	1,654,600	1,660,900	1,648,600	1,654,600	1,641,000	1,673,100
準備預金残	1,522,100	1,520,800	1,514,900	1,516,800	1,501,700	1,532,600
レート	0.060%	0.061%	0.060%	0.060%	0.059%	0.059%
月中平均	0.05910%	0.05918%	0.05922%	0.05931%	0.05930%	0.05929%

10/27のマナタリーベース		2,555,800	
10/27コール	合計 176,649	無担 69,777	有担 106,872
コール前日増減	計 ▲ 1,786	無担 ▲ 1,727	有担 ▲ 59

10/28の加重平均レート(速報)				10/27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 (0.059)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.045 ~0.135 (0.059)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.055 ~0.125 (0.086)				T/N	0.055 ~0.120 (0.073)			
				S/N				
				1W	0.117 ~0.400 (0.121)			
0.118 ~0.255 (0.187)				2W	0.118 ~0.145 (0.132)			
				3W				
		0.08-0.12	-	1M	0.118 ~0.145 (0.127)		有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
0.175 (0.175)		0.08-0.12	▲0.04-▲0.035	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

◀オペ情報、入札結果▶

CP買入 4,000億円 10/31 応札 5,835億円 落札 3,680億円 按分利回り較差 0.065% 30.0% 平均利回り較差 0.080%
 米ドル資金供給(固定金利方式) 10/30~11/6(7日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.580%
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札11兆8,707億円 落札2兆4,738億円(I非競争入札:2,253億円) 11/17~2016/11/15 0.017% 按分11.6234% 平均0.012%
 交付税特会 1兆500億円 11/5~2015/5/8 応札 2兆9,405億円 落札 1兆500億円 0.090% 按分 89.5106% 平均 0.085%

「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