

<<資金需給>>

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想	31日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 500	▲ 1,500	▲ 1,000
財政		▲ 1,500	0	▲ 1,400
資金過不足		▲ 2,000	▲ 1,500	▲ 2,400
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				4,700
93,489				▲ 9,700
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		3,100		10,500
CP等買入				3,700
		▲ 200	▲ 100	
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		200	100	
国債補完供給				
小計		3,100	0	9,200
当預増減		1,100	▲ 1,500	6,800

<< 10/30の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,672,700	前日比	▲ 1,500
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。

<< 29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5,000億円減少の126兆円(当座預金残高見込みは167兆4,000億円)。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。本日の共通担保オペはT+2スタートの3M物が1兆5,000億円オフアされた。結果は応札総額4,701億円の札割れとなり、オペ期落ち分の9,730億円を大幅に下回った。

<< 29日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は品薄感が強い中、3M物(489回)が▲0.04~▲0.045%で出合いが見られた程度で、動意に乏しく閑散であった。CP市場は償還総額8,500億円程度に対し、月末発行となったことで、発行案件多く発行総額は6,000億円強に膨らんだ。発行レートは、小幅低下となった銘柄が多く見られた。

<< 30日の材料 >>
 *米国7-9月期のGDP速報値
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、11/4発行)

当座預金残高	1,674,200	10/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,527,000		35,700
積み終了先	1,255,100	10/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,255,100	積数	32,300
非準預先残高	147,200	1日平均	1,900
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	98.32% (実績)	45.16% (日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	108.12-13
0.465	0.005	15,553.91	224.00
		為替(5時)	108.07-08

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	10/22	10/23	10/24	10/27	10/28	10/29
日銀当預残	1,660,900	1,648,600	1,654,600	1,641,000	1,673,100	1,674,200
準備預金残	1,520,800	1,514,900	1,516,800	1,501,700	1,532,600	1,527,000
レート	0.061%	0.060%	0.060%	0.059%	0.059%	0.059%
月中平均	0.05918%	0.05922%	0.05931%	0.05930%	0.05929%	0.05928%

10/28のマナタリーベース				2,588,200
10/28コール	合計	178,246	無担	73,157
コール前日増減	計	1,597	無担	3,380
			有担	▲ 1,783

10/29の加重平均レート(速報)				10/28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 ~0.075 (0.059)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.045 ~0.135 (0.059)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.056 ~0.120 (0.070)				T/N	0.055 ~0.125 (0.086)			
0.055 (0.055)				S/N				
0.088 (0.088)				1W				
0.175 (0.175)				2W	0.118 ~0.255 (0.187)			
				3W				
		0.08-0.12	-	1M			有担先日付分	
0.090 (0.090)		0.08-0.12	-	2M				
0.117 (0.117)		0.08-0.12	▲0.045-▲0.04	3M	0.175 (0.175)			
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	10/31	~ 2/10 (102日間)	応札	4,701億円	落札	4,701億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債買入	3,500億円	10/31		応札	11,156億円	落札	3,502億円	按分利回り較差	0.006%	40.3%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	3,000億円	10/31		応札	16,253億円	落札	3,003億円	按分利回り較差	0.004%	31.3%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	10/31		応札	17,236億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	0.002%	18.2%	平均利回り較差	0.003%

「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