

<<資金需給>>

単位 億円

	1日需給速報		2日需給予想		5日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 500		▲ 400		1,000
財政		1,400		▲ 30,500		▲ 31,000
資金過不足		900		▲ 30,900		▲ 30,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						1,500
62,701						▲ 1,800
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				12,000		
CP等買入						
		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028						
被災地支援						
3,166						
社債等買入						
ETF買入				200		
国債補充供給	即日	400				
小計		300		12,100		▲ 300
当預増減		1,200		▲ 18,800		▲ 30,300

当座預金残高	2,423,600	10/1以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,202,100		5,600
積み終了先	1,820,300	10/2以降の残り所要積立額	
超過準備	1,819,800	積数	4,200
非準備先残高	221,500	1日平均	300
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,952,600		
準備預金進捗率	99.78%	(実績)	53.33% (日数)

9/30のマネタリーベース		3,384,400	
9/30コール	合計	204,167	無担 55,919 有担 148,248
コール前日増減	計	▲ 13,446	無担 ▲ 23,296 有担 9,850

10/1の加重平均レート(速報)				9/30の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.050 ~0.130 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)		O/N	0.001 ~0.075 (0.010)	0.030	(0.030)
0.050 ~0.121 (0.080)				T/N		0.070	~0.125 (0.080)
				S/N			
0.070 ~0.155 (0.117)				1W		0.075	~0.122 (0.109)
0.160 (0.160)				2W		0.116	~0.310 (0.142)
				3W		0.077	~0.110 (0.094)
0.116 ~0.245 (0.167)				1M		0.070	(0.070)
				2M			
0.630 (0.630)				3M			
				6M			
				1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	10/5	~	1/4 (91日間)	応札	1,500億円	落札	1,500億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	2,325億円	10/1	~	10/2 (1日間)	応札	8億円	落札	8億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債補完	5,768億円	10/1	~	10/2 (1日間)	応札	34億円	落札	34億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
T-Bill3M	応札21兆5,611億1,000万円	落札4兆3,561億4,000万円	(非競争入札:3,938億円)	10/5~2016/1/12	▲0.0110%	按分28.8191%	平均▲0.0188%					
10年利付国債(表面利率0.4%)	応札6兆6,176億円	落札2兆1,864億円	(I非競争入札:2,101億円)	10/5~2025/9/20	0.339%	按分4.5828%	平均0.336%					

「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。」

<< 10/2の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,404,800	前日比	▲ 18,800
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.07~0.08%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

<< 1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7,000億円減の182兆円(当座預金残高見込みは242兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態を中心に0.075%近辺の調達希望で始まった。昨日の四半期末要因は剥落しており、まとまった金額に対しては0.077~0.079%程度での出合いが散見された。一巡後は大方のビッド水準が低下し、0.07~0.075%程度の出合いが散見される中で本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態によるロール案件の取引が中心となった。共通担保オペは、今年初の年末越えとなる3M物が8,000億円オファーされた。結果は1,500億円の落札となり、期落ち分1,800億円とほぼ同水準であった。

<< 1日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは前日から横ばい圏で推移した。短国市場は3M物の入札が実施された。結果は平均落札利回▲0.0188%、按分落札利回▲0.011% (按分比率28.819%)と強めの決着となった。セカンダリーは▲0.03~▲0.02%で推移した。その他には、短国買入オペを睨んでか、1Y物で▲0.099%の出合いがみられた。CP市場は鉄鋼業態からまとまった発行がみられたものの、発行案件が少なく、発行総額は800億円程度となった。発行レートは横ばい圏で推移した。

<< 2日の材料 >>
 *8月の完全失業率(市場予想:3.3%)
 *8月の有効求人倍率(市場予想:1.22倍)
 *8月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+0.4%)
 *9月のマネタリーベース *10月の日銀当座預金増減要因見込み
 *米国8月の製造業新規受注・出荷・在庫 *米国9月の雇用統計

<<コール9月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07457%	有担 0.03090%
(営業日のみ)	無担	0.07337%	有担 0.03084%
JGB新発10年債	0.325	▲ 0.020	
日経平均株価(終値)	17,722.42	334.27	
為替(9時)	119.87-89		
為替(5時)	120.20-21		

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	9/24	9/25	9/28	9/29	9/30	10/1
日銀当預残	2,403,400	2,422,300	2,433,100	2,419,500	2,422,400	2,423,600
準備預金残	2,196,000	2,210,600	2,220,400	2,201,900	2,206,700	2,202,100
レート	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.010%	0.076%
月中平均	0.07683%	0.07685%	0.07682%	0.07679%	0.07457%	0.07600%

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