

<<資金需給>>

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,000	▲ 1,200	0
財政		▲ 2,400	▲ 300	▲ 48,000
資金過不足		▲ 3,400	▲ 1,500	▲ 48,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			3,400	600
62,401			▲ 700	▲ 1,100
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				
CP等買入		▲ 200	4,000	▲ 300
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		100	200	
国債補充供給		500		
小計		400	6,600	▲ 500
当預増減		▲ 3,000	5,100	▲ 48,500

<< 10/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,411,200	前日比	5,100
O/N	0.065~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.065~0.08%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 8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180兆7,000億円(当座預金残高見込みは240兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.075~0.076%、大手行から0.07~0.075%程度での調達で始まった。まとまった金額に対しては引き続き0.077~0.078%程度での出合いも散見されたが、一巡後は0.07~0.075%前後の調達で推移し本日の取引を終了した。ターム物については、取引閑散であった。3M物の共通担保オベが8,000億円オファーされ、結果は落札総額600億円(期落ち額1,050億円)となった。

<< 8日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは上昇した。短国市場は3M物の入札が実施された。W I取引において▲0.015%と強めの出合いが見られたものの、平均落札利回▲0.0105%、最高落札利回▲0.0056%と、概ね事前予想通りの結果となり、前回債ほどの過熱感は無くなった。セカンダリーは▲0.005~▲0.003%の出合いと小動きであった。CP市場は大型の発行案件が複数あり、発行総額は1,400億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいであった。

<< 9日の材料 >>
 *8月の特定サービス産業動態統計速報
 *米国8月の卸売売上高

当座預金残高	2,406,100	10/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,186,700		300
積み終了先	1,806,200	10/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,806,200	積数	200
非準備先残高	219,400	1日平均	0
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,960,800		
準備預金進捗率	99.99% (実績)	76.67% (日数)	

JGB新発10年債	0.325	0.000	日経平均株価(終値)	18,141.17	▲ 181.81	為替(9時)	119.92-94
						為替(5時)	119.80-82

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	10/1	10/2	10/5	10/6	10/7	10/8
日銀当預残	2,423,600	2,405,700	2,374,700	2,394,700	2,409,100	2,406,100
準備預金残	2,202,100	2,188,000	2,162,200	2,177,800	2,188,200	2,186,700
レート	0.076%	0.076%	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07600%	0.07600%	0.07620%	0.07633%	0.07629%	0.07638%

10/7のマネタリーベース				3,369,300		
10/7コール	合計	200,142	無担	65,206	有担	134,936
コール前日増減	計	4,683	無担	4,195	有担	488

10/8の加重平均レート(速報)				10/7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	有担先日付分	
0.060 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.020 ~0.130 (0.076)				T/N		0.070 ~0.121 (0.080)		
				S/N		0.077 ~0.078 (0.078)		
0.098 (0.098)				1W		0.070 ~0.122 (0.080)		
0.114 ~0.145 (0.130)				2W		0.118 ~0.310 (0.135)		
				3W		0.118 (0.118)		
		0.07-0.12	-	1M		0.170 (0.170)		有担先日付分
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.015-▲0.003	3M				
		-	▲0.089-▲0.082	6M				
		-	-	1Y				

<< オベ情報、入札結果 >>
 全店共通 8,000億円 10/13 ~ 1/12 (91日間) 応札 600億円 落札 600億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 国債補充 4,000億円 10/8 ~ 10/9 (1日間) 0億円 0億円 0% 按分 平均 (即)

T-Bill3M 応札18兆7,414億円 落札4兆4,025億6,000万円(非競争入札:3,974億円) 10/13~2016/1/18 ▲0.0056% 按分24.5617% 平均▲0.0105%
 30年利付国債(表面利率1.4%) 応札2兆4,235億円 落札7,279億円(I非競争入札:712億円) 10/13~2045/9/20 1.353% 按分74.0157% 平均1.350%

「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