

**<<資金需給>>**

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想	19日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 800	▲ 900	1,000
財政		50,100	▲ 22,900	3,000
資金過不足		49,300	▲ 23,800	4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,000
64,612				▲ 1,000
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		4,800		11,800
CP等買入				
		▲ 600	▲ 400	
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			▲ 400	
ETF買入		200		
国債補完供給				
小計		4,400	▲ 800	12,800
当預増減		53,700	▲ 24,600	16,800

<< 10/16の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,418,000	前日比	▲ 24,600
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。

<< 15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3兆4,000億円増の182兆3,000億円(当座預金残高見込みは244兆3,000億円)。積みの最終日となる本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態を中心に0.075~0.076%近辺の調達希望で始まった。まとまった金額に対しては昨日と同水準で0.077~0.078%程度での出合いも一部で見られた。一巡後は0.07%近辺での出合いで本日の取引を終えた。ターム物の出合いは閑散であった。共通担保オベが3M・8,000億円でオファーされ、結果は1,980億円(期落ち分960億円)となった。

<< 15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3M物の入札が実施された。W I 取引で▲0.008~▲0.007%とやや強めの出合いが見られたが、平均落札利回▲0.0055%、最高落札利回▲0.0037%と概ね予想通りの結果になった。セカンダリーは、▲0.002%での出合いから始まり、店頭の買いからか、引けにかけて▲0.010%まで買い進まれた。CP市場は、鉄鋼、小売等による発行があり、発行総額は800億円程度となった。発行レートは引続き横ばいで推移した。

- << 16日の材料 >>
- \*黒田日銀総裁、全国信用組合大会にて講演
  - \*米国9月の鉱工業生産・設備稼働率
  - \*米国10月のミシガン大消費者信頼感指数速報
  - \*ユーロ圏9月の消費者物価指数改定値
  - \*国庫短期証券入札(1年、25,000億円、10/20発行)
  - \*流動性供給入札(5,000億円、10/20発行)

<<コール9月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07457%	有担 0.03090%
(営業日のみ)	無担	0.07339%	有担 0.03083%

当座預金残高	2,442,600	10/15以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,217,300		0
積み終了先	1,818,600	10/16以降の残り所要積立額	
超過準備	1,818,600	積数	2,019,500
非準備先残高	225,300	1日平均	65,100
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,960,800		

10月の新所要見込 **65,100** (一日平均)

10/14のマネタリーベース		3,348,800	
10/14コール	合計	195,113	無担 61,974 有担 133,139
コール前日増減	計	▲ 2,369	無担 ▲ 4,103 有担 1,734

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	118.85-86
0.315	0.010	為替(5時)	118.37-38

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	10/7	10/8	10/9	10/13	10/14	10/15
日銀当預残	2,409,100	2,406,100	2,410,300	2,355,100	2,388,900	2,442,600
準備預金残	2,188,200	2,186,700	2,190,100	2,141,400	2,166,300	2,217,300
レート	0.076%	0.077%	0.075%	0.076%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07629%	0.07638%	0.07592%	0.07592%	0.07593%	0.07593%

10/15の加重平均レート(速報)				10/14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 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.065 ~0.125 (0.076)			0.030 ~0.040 (0.031)		
0.050 ~0.121 (0.078)				T/N			0.070 ~0.121 (0.079)		
				S/N					
				1W			0.070 ~0.130 (0.104)		
				2W			0.310 (0.310)		
				3W			0.140 (0.140)		
0.140 (0.140)		0.07-0.12	-	1M			0.078 (0.078)	有担先日付分	
0.630 (0.630)		0.07-0.11	-	2M					
		0.07-0.11	▲0.010-▲0.002	3M					
		-	▲0.105-▲0.100	6M					
		-	-	1Y					

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通	8,000億円	10/19	~ 1/18 (91日間)	応札	1,980億円	落札	1,980億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	2,351億円	10/15	~ 10/16 (1日間)	応札	5億円	落札	5億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	10/19	応札	18,392億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	0.006%	24.8%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	10/19	応札	18,309億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	0.003%	5.3%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,400億円	10/19	応札	6,383億円	落札	2,408億円	按分利回り較差	0.005%	79.9%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	1,400億円	10/19	応札	5,316億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	0.006%	4.4%	平均利回り較差	0.008%
T-Bill3M	応札19兆2,790億円	落札4兆4,354億円	(非競争入札:3,945億円)	10/19~2016/1/25	▲0.0037%	按分92.3488%	平均▲0.0055%				
J-REIT買入	12億円	約定日	10/15								

「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