

《資金需給》

単位 億円

	20日需給速報		21日需給予想		22日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 1,600	▲ 1,000		
財政		▲ 15,300	7,200	▲ 14,000		
資金過不足		▲ 15,900	5,600	▲ 15,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
65,632						
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入			15,000			
国庫短期証売却						
国債買入			12,100			
CP等買入					4,000	
貸出支援基金(成長)		▲ 500				
51,505						
(増加) 252,028						
被災地支援						
3,166						
社債等買入		1,300	▲ 100			
		▲ 100				
ETF買入		100				
国債補完供給	即日	▲ 300	300			
		100				
小計		600	27,300	4,000		
当増減		▲ 15,300	32,900	▲ 11,000		

10/21の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,449,300	前日比	32,900
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%前後での出会いが中心になると見込まれる。

20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2兆7千円減の179兆6,000億円(当座預金残高見込みは241兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、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。昨日とほぼ横ばいで、立ち上がりは0.075~0.077%での出会いであった。一巡後は0.065~0.07%近辺での出会いが散見される中で本日の取引を終えた。ターム物は閑散であった。

20日のオープン市場動向
 現先レートは横ばい圏での動きとなった。短国市場では特段目立った動きも無く閑散。CP市場は、償還総額700億円程度に対し、発行総額は1,100億円程度であった。発行レートは、一部に強めの決着も見られたものの、概ね横ばい圏での動きとなった。

21日の材料
 *9月の貿易統計
 *交付税特別会計借入(10,500億円、10/29借入)

《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	2,416,400	10/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,189,300		86,700
積み終了先	1,772,500	10/21以降の残り所要積立額	
超過準備	1,767,900	積数	64,500
非準預先残高	227,100	1日平均	2,500
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)	2,019,500		
準備預金進捗率	96.81%	(実績)	16.13% (日数)

JGB新発10年債	0.310	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	18,207.15	75.92	為替(9時)	119.50-51
						為替(5時)	119.64-66

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	10/13	10/14	10/15	10/16	10/19	10/20
日銀当預残	2,355,100	2,388,900	2,442,600	2,417,900	2,431,700	2,416,400
準備預金残	2,141,400	2,166,300	2,217,500	2,199,000	2,211,200	2,189,300
レート	0.076%	0.076%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07592%	0.07593%	0.07593%	0.07611%	0.07611%	0.07610%

10/19のマナタリーベース					3,393,500	
10/19コール	合計	190,945	無担	56,145	有担	134,800
コール前日増減	計	▲ 2,309	無担	▲ 1,976	有担	▲ 333

10/20の加重平均レート(速報)				10/19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 0.060 ~0.130 (0.076)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.070 ~0.121 (0.080)					0.070 ~0.121 (0.080)			
0.117 ~0.165 (0.141)				1W	0.099 (0.099)			
				2W	0.340 (0.340)			
				3W				
		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
0.080 (0.080)		0.07-0.11	-	3M				
		-	-	6M				
		-	▲ 0.045	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完 8,000億円 10/20 ~ 10/21 (1日間) 応札 252億円 落札 252億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 10/22~10/29 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.620%
 20年利付国債(表面利率1.2%) 応札3兆3,561億円 落札1兆1,038億円(I非競争入札:956億円) 10/22~2035/9/20 1.083% 按分66.3038% 平均1.078%

「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