

＜資金需給＞

単位 億円

	21日需給速報		22日需給予想		23日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,700	▲ 2,000	▲ 2,000		
財政		4,600	▲ 12,700	2,000		
資金過不足		2,900	▲ 14,700	0		
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		7,800		
CP等買入			4,000			
			▲ 900			
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028						
被災地支援					100	
3,166					▲ 100	
社債等買入		▲ 100				
ETF買入						
国債補完供給		300				
小計		27,300	3,100	7,800		
当預増減		30,200	▲ 11,600	7,800		

当座預金残高	2,446,600	10/21以降の残り所要積立額	64,500
準備預金残高	2,215,200		
積み終了先	1,801,100	10/22以降の残り所要積立額	
超過準備	1,799,700	積数	47,300
非準備先残高	231,400	1日平均	1,900
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	97.66% (実績)		19.35% (日数)

10/20のマナタリーベース		3,378,700	
10/20コール 合計	190,322 無担	56,332 有担	133,990
コール前日増減	計 ▲ 623 無担	187 有担	▲ 810

10/21の加重平均レート(速報)				10/20の加重平均レート(確報)			
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 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.072 ~0.125 (0.088)				T/N	0.070 ~0.121 (0.080)		
				S/N			
				1W			
0.310 (0.310)				2W	0.117 ~0.165 (0.141)		
				3W			
		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分
		0.07-0.11	-	2M			
		0.07-0.11	▲ 0.009	3M	0.080 (0.080)		
		-	-	6M			
		-	▲ 0.055-▲ 0.052	1Y			

＜オペ情報、入札結果＞

国債補完	4,000億円	10/21 ~ 10/22 (1日間)	0億円	0億円	按分	平均	(即)		
国債買入	4,000億円	10/23 応札	12,495億円 落札	4,009億円	按分利回り較差	0.003%	53.8%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	2,400億円	10/23 応札	5,403億円 落札	2,403億円	按分利回り較差	0.008%	51.5%	平均利回り較差	0.011%
国債買入	1,400億円	10/23 応札	4,304億円 落札	1,404億円	按分利回り較差	0.011%	48.6%	平均利回り較差	0.014%
交付税特会	1兆500億円	10/29~2016/4/28 応札	2兆9,200億円 落札	1兆500億200万円	0.072%	按分14.2860%	平均0.070%		

10/22の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,435,000	前日比	▲ 11,600
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。					

21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3兆5,000億円増の183兆1,000億円(当座預金残高見込みは244兆9,000億円)。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。立ち上がりは前日比ほぼ横ばいで0.075~0.077%での出合いであった。一巡後も同水準の出合いで本日の取引を終えた。ターム物はロール案件が見られた程度で、閑散であった。

21日のオープン市場動向
 現先レートは横ばい圏での動き。短国市場は、1Y物が▲0.055~▲0.052%、3M物が店頭で購入ニーズから▲0.009%で出合いが見られた程度で、閑散であった。CP市場は、償還総額400億円程度に対し五・十日発行に当たったことから、発行総額は1,700億円程度に膨らんだ。発行レートは、投資家の運用ニーズが強く、一部銘柄において引続き強めの決着がみられていたものの、概ね横ばい圏での動きとなった。

22日の材料
 *米国9月の中古住宅販売
 *ECB定例理事会(金融政策発表)
 *国庫短期証券入札(3か月、48,000億円、10/26発行)
 *2年利付国債入札(25,000億円、11/16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%

JGB新発10年債	0.315	0.005	日経平均株価(終値)	18,554.28	347.13	為替(9時)	119.79-80
						為替(5時)	119.86-88

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	10/14	10/15	10/16	10/19	10/20	10/21
日銀当預残	2,388,900	2,442,600	2,417,900	2,431,700	2,416,400	2,446,600
準備預金残	2,166,300	2,217,500	2,199,000	2,211,200	2,189,300	2,215,200
レート	0.076%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07593%	0.07593%	0.07611%	0.07611%	0.07610%	0.07610%

「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