

<<資金需給>>

単位 億円

	22日需給速報		23日需給予想	26日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,200	▲ 2,000	0
財政		▲ 13,800	2,800	2,000
資金過不足		▲ 16,000	800	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				3,300
65,632				▲ 2,800
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			8,000	
CP等買入		4,000	▲ 300	
		▲ 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			▲ 400	
ETF買入			200	
国債補完供給				
小計		3,100	7,500	500
当預増減		▲ 12,900	8,300	2,500

10/23の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,442,000	前日比	8,300
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。

<< 22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1兆4,000億円減の181兆7,000億円(当座預金残高見込みは243兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態を中心に0.075~0.077%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは前日比横ばいで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、大手行から1W物0.117%でまとまった調達が見られた。3M物の共通担保オペが8,000億円オファーされ、応札額3,331億円と、期落ち分(2,841億円)から若干増加する結果となった。

<< 22日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばい圏で推移。短国市場では3M物入札が実施された。W I取引において▲0.005%で出合っていたこともあり、平均落札利回り▲0.0044%。按分落札利回り▲0.0037%と概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーは在庫処分とみられる売りから▲0.002%での出合いが見られるなど、小甘い展開となった。CP市場は償還総額1,600億円程度に対し、鉄鋼メーカーより500億円を超える大型発行案件もあり発行総額は3,000億円程度に膨らんだ。発行レートは、ディーラー・投資家の玉確保のニーズが底堅く、横ばい圏での動きとなった。

<< 23日の材料 >>
 *8月の景気動向指数改訂状況

当座預金残高	2,433,700	10/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,216,200		47,300
積み終了先	1,806,200	10/23以降の残り所要積立額	
超過準備	1,804,200	積数	35,200
非準預先残高	217,500	1日平均	1,500
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	98.26%	(実績)	22.58%
		(日数)	

JGB新発10年債	0.305	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	18,435.87	▲ 118.41	為替(9時)	119.86-88
						為替(5時)	119.68-70

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	10/15	10/16	10/19	10/20	10/21	10/22
日銀当預残	2,442,600	2,417,900	2,431,700	2,416,400	2,446,600	2,433,700
準備預金残	2,217,500	2,199,000	2,211,200	2,189,300	2,215,200	2,216,200
レート	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07593%	0.07611%	0.07611%	0.07610%	0.07610%	0.07609%

10/21のマネタリーベース				3,410,700
10/21コール	合計	189,797	無担	55,728
			有担	134,069
コール前日増減	計	▲ 525	無担	▲ 604
			有担	79

10/22の加重平均レート(速報)				10/21の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
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)
0.075 ~0.125 (0.082)				T/N		0.072 ~0.125 (0.088)		
0.125 (0.125)				S/N				
0.098 ~0.117 (0.117)				1W				
0.160 (0.160)				2W		0.310 (0.310)		
				3W				
		0.07-0.12	-	1M				有担先日付分
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.005-▲0.002	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.058-▲0.048	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 10/26 ~ 1/25 (91日間) 応札 3,331億円 落札 3,331億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 国債補完 703億円 10/22 ~ 10/23 (1日間) 0億円 0億円 按分 平均 (即)
 T-Bill3M 応札19兆1,413億円 落札4兆3,700億2,000万円(非競争入札:4,099億円) 10/26~2016/2/1 ▲0.0037% 按分58.6469% 平均▲0.0044%
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札9兆6,556億円 落札2兆3,006億円(I非競争入札:1,986億円) 11/16~2017/11/15 0.012% 按分98.1362% 平均0.011%

「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り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