

**<<資金需給>>**

単位 億円

	26日需給速報		27日需給予想	28日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 500	0
財政		5,900	4,800	0
資金過不足		5,800	4,300	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		3,300		
66,122		▲ 2,800		
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				
		▲ 700	▲ 200	
貸出支援基金				
(成長) 51,505				
(増加) 252,028				
被災地支援				
3,161				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 300	26,900	0
当預増減		5,500	31,200	0

<< 10/27の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,477,400	前日比	31,200
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。

<< 26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9,000億円増の183兆7,000億円(当座預金残高見込みは244兆7,000億円)。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。週末要因が剥落したことなどで小幅低下し、立ち上がりは0.075~0.077%での出合いであった。一巡後は0.07~0.075%近辺の出合いで本日の取引を終えた。ターム物は閑散であった。

<< 26日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、総じて閑散とした地合いの中、3Mで▲0.003%、1Yで▲0.055%の出合いが見られた程度であった。CP市場は1,200億円弱の償還に対して400億円強の発行が行われるなど、落ち着いたマーケットとなった。レート水準に目立った変動は見られず、横ばい圏での決着となっていた。

<< 27日の材料 >>

- \*9月の企業向けサービス価格指数
- \*米国FOMC(1日目)
- \*米国8月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- \*米国9月の耐久財新規受注
- \*米国10月のCB消費者信頼感指数
- \*英国7-9月期のGDP速報値
- \*40年利付国債入札(4,000億円、10/29発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、11/5借入)

当座預金残高	2,446,200	10/26以降の残り所要積立額	13,400
準備預金残高	2,227,300	10/27以降の残り所要積立額	9,300
積み終了先	1,825,200	積数	500
超過準備	1,824,600	1日平均	500
非準備先残高	218,900		
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	99.54% (実績)	35.48% (日数)	

JGB新発10年債	0.310	0.010	日経平均株価(終値)	18,947.12	121.82	為替(9時)	121.31-32
						為替(5時)	120.95-97

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	10/19	10/20	10/21	10/22	10/23	10/26
日銀当預残	2,431,700	2,416,400	2,446,600	2,433,700	2,440,700	2,446,200
準備預金残	2,211,200	2,189,300	2,215,200	2,216,200	2,223,600	2,227,300
レート	0.076%	0.076%	0.076%	0.076%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07611%	0.07610%	0.07610%	0.07609%	0.07620%	0.07619%

10/23のマナターベース				3,409,000
10/23コール	合計	198,835	無担	65,624
			有担	133,211
コール前日増減	計	9,347	無担	10,007
			有担	▲ 660

10/26の加重平均レート(速報)				10/23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		
0.055 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.072 ~0.125 (0.079)					0.072 ~0.121 (0.081)			
0.113 (0.113)					0.100 (0.100)			
0.145 ~0.160 (0.153)					0.075 ~0.145 (0.081)			
		0.07-0.12	-				有担先日付分	
		0.07-0.11	-					
		0.07-0.11	▲0.003					
		-	-					
		-	▲0.055					

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 20,000億円 10/26 ~ 10/27 (1日間) 応札 6億円 落札 6億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

「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