

<<資金需給>>

単位 億円

	27日需給速報		28日需給予想	29日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 800	▲ 1,000
財政		3,600	800	▲ 5,000
資金過不足		3,000	0	▲ 6,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
66,122				
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				
		▲ 200	▲ 100	
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		26,900	▲ 200	0
当預増減		29,900	▲ 200	▲ 6,000

<< 10/28の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,475,900	前日比	▲ 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。

<< 27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2兆5,000億円増の186兆2,000億円(当座預金残高見込みは247兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態を中心に0.075~0.077%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.075~0.077%での出合いであった。一巡後の出合いは昨日と同水準の0.07~0.075%前後を中心に推移し、本日の取引を終了した。ターム物は証券業態のロール案件が散見された。

<< 27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、引き続き閑散とした地合いが継続する中、3M▲0.003~▲0.002%での散発的な出合いが見られた程度であった。CP市場は、700億円程度の償還に対して、1,200億円程度の発行となった。発行レートは横ばい圏での動きとなった。

<< 28日の材料 >>
 *9月の商業動態統計速報
 *米国FOMC(2日目)

当座預金残高	2,476,100	10/27以降の残り所要積立額	9,300
準備預金残高	2,256,000	10/28以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,855,100	積数	7,200
超過準備	1,853,700	1日平均	400
非準預先残高	220,100	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	99.64% (実績)		38.71% (日数)

JGB新発10年債	0.300 ▲ 0.010	日経平均株価(終値)	18,777.04 ▲ 170.08	為替(9時)	120.95-98
				為替(5時)	120.47-49

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	10/20	10/21	10/22	10/23	10/26	10/27
日銀当預残	2,416,400	2,446,600	2,433,700	2,440,700	2,446,200	2,476,100
準備預金残	2,189,300	2,215,200	2,216,200	2,223,600	2,227,300	2,256,000
レート	0.076%	0.076%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07610%	0.07610%	0.07609%	0.07620%	0.07619%	0.07619%

10/26のマネタリーベース				3,414,600		
10/26コール	合計	196,538	無担	64,056	有担	132,482
コール前日増減	計	▲ 2,297	無担	▲ 1,568	有担	▲ 729

10/27の加重平均レート(速報)				10/26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		
0.030 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.125 (0.076)			0.030 ~0.040 (0.031)		
0.072 ~0.121 (0.081)				T/N		0.072 ~0.125 (0.079)			
				S/N					
				1W		0.113 (0.113)			
0.065 ~0.165 (0.117)				2W	0.160 (0.160)	0.145 (0.145)			
				3W					
0.200 (0.200)		0.07-0.12	-	1M				有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M					
		0.07-0.11	▲0.003-▲0.002	3M					
		-	-	6M					
		-	▲0.055	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

CP買入 4,000億円 10/30 応札 8,300億円 落札 3,993億円 按分レート 0.065% 12.2% 平均落札レート 0.073%
 米ドル資金供給(固定金利方式) 10/29~11/6(8日間) 応札なし 貸付利率 0.620%
 40年利付国債(表面利率1.4%) 応札1兆1,532億円 落札3,993億円 10/29~2055/3/20 1.475% 按分27.5773%
 交付税特会 1兆500億円 11/5~2016/5/6 応札 2兆9,800億円 落札1兆500億円 0.070% 按分 55.5558% 平均 0.069%

「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