

《資金需給》

単位 億円

	28日需給速報		29日需給予想		30日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 800	▲ 1,200	▲ 2,000		
財政		▲ 2,200	▲ 1,300	▲ 1,000		
資金過不足		▲ 3,000	▲ 2,500	▲ 3,000		
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						
国庫短期証売却						
国債買入					5,000	
CP等買入					4,000	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028		▲ 100	▲ 300			
被災地支援						
3,161						
社債等買入		▲ 100	▲ 100			
ETF買入						
国債補充供給						
小計		▲ 200	▲ 400		9,000	
当預増減		▲ 3,200	▲ 2,900		6,000	

10/29の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,470,000	前日比	▲ 2,900
O/N	0.07~0.08	T/N	0.05~0.12	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。

《 28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1,000億円減の186兆1,000億円(当座預金残高見込みは247兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態を中心に0.075~0.077%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。一巡後もほぼ同水準の0.075%近辺を中心に推移し、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の出合いが見られた。

《 28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、3M ▲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、月末発行日にあたり、9,500億円程度の償還に対して、7,500億円程度の発行となった。償還超ではあったものの、鉄鋼業態等から大型発行案件も複数実施される活況な市場となった。発行レートは横ばい圏での決着であった。

《 29日の材料 》
 *9月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比▲0.5%)
 *米国7-9月期のGDP速報値
 *国庫短期証券入札(3か月、48,000億円、11/2発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、11/12借入)

当座預金残高	2,472,900	10/28以降の残り所要積立額	7,200
準備預金残高	2,250,800	10/29以降の残り所要積立額	6,500
積み終了先	1,853,300	積数	400
超過準備	1,853,200	1日平均	400
非準預先残高	222,100		
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)	2,018,900		
準備預金進捗率	99.68% (実績)	41.94% (日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.48-49
0.290 ▲ 0.010	18,903.02 125.98	為替(5時)	120.44-45

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	10/21	10/22	10/23	10/26	10/27	10/28
日銀当預残	2,446,600	2,433,700	2,440,700	2,446,200	2,476,100	2,472,900
準備預金残	2,215,200	2,216,200	2,223,600	2,227,300	2,256,400	2,250,800
レート	0.076%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07610%	0.07609%	0.07620%	0.07619%	0.07619%	0.07618%

10/27のマナリーベース				3,445,000		
10/27コール	合計	198,200	無担	64,501	有担	133,699
コール前日増減	計	1,662	無担	445	有担	1,217

10/28の加重平均レート(速報)				10/27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		有担当日分	
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)					O/N	0.030 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.072 ~0.130 (0.085)						T/N		0.072 ~0.121 (0.081)	
0.060 ~0.070 (0.061)						S/N			
0.098 (0.098)						1W			
0.073 ~0.310 (0.088)						2W		0.065 ~0.165 (0.117)	
						3W			
				0.07-0.12	-	1M		0.200 (0.200)	有担先日付分
				0.07-0.11	-	2M			
0.140 (0.140)				0.07-0.11	▲0.002	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

《オベ情報、入札結果》

国債買入	2,400億円	10/30	応札	5,125億円	落札	2,406億円	按分利回り較差	-0.005%	73.7%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	1,400億円	10/30	応札	4,657億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	-0.002%	77.1%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	1,200億円	10/30	応札	4,383億円	落札	1,201億円	按分価格較差	-1.510円	19.4%	平均価格較差	-1.721円

「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