

**<<資金需給>>**

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想	2日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,500	▲ 1,400	0
財政		▲ 2,300	▲ 1,300	▲ 10,000
資金過不足		▲ 3,800	▲ 2,700	▲ 10,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				500
66,122				▲ 1,100
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			5,400	12,000
CP等買入			4,000	
		▲ 300	▲ 3,300	
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				
国債補充供給				
小計		▲ 400	6,100	11,400
当預増減		▲ 4,200	3,400	1,400

<< 10/30の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,472,100	前日比	3,400
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.06~0.08%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 29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9,000億円減の185兆2,000億円(当座預金残高見込みは247兆円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態を中心に0.075~0.077%近辺、大手行からは0.075%で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%近辺の推移であった。ターム物は閑散であった。3M物の共通担保オペが8,000億円オフアールされ、落札額525億円と、期落ち分からはほぼ半減する結果となった。

<< 29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の入札が実施された。WI取引で▲0.004%の出合いが見られる中、入札結果は平均落札利回り▲0.0037%、按分落札利回り▲0.0018%と概ね事前予想通りの堅調な結果となった。セカンダリーでは、3Mで▲0.002~▲0.001%、1Yで▲0.06~▲0.056%の出合いが見られた。CP市場は、石油・機械業態等から大型発行案件も実施され、700億円弱の償還に対し、3,000億円程度の発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。

<< 30日の材料 >>

\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(終了後、直ちに結果公表)

\*経済・物価情勢の展望 \*黒田日銀総裁定例会見

\*9月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+0.3%)

\*9月の完全失業率(市場予想:3.4%)

\*9月の有効求人倍率(市場予想:1.24倍)

\*9月全国・10月都都区部消費者物価指数(CPI)

市場予想:全 国(9月)前年比同月比(除く生鮮):▲0.2%

東京都区部(10月)前年比同月比(除く生鮮):▲0.1%

\*9月の住宅着工統計

\*米国9月の個人所得・消費支出 \*米国10月のシカゴPM景況感指数

\*ユーロ圏10月の消費者物価指数速報値

当座預金残高	2,468,700	10/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,240,800		6,500
積み終了先	1,841,900	10/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,841,900	積数	6,100
非準備先残高	227,900	1日平均	400
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	99.70%	(実績)	45.16% (日数)

JGB新発10年債	0.290	0.000	日経平均株価(終値)	18,935.71	32.69	為替(9時)	120.87-89
						為替(5時)	120.77-79

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	10/22	10/23	10/26	10/27	10/28	10/29
日銀当預残	2,433,700	2,440,700	2,446,200	2,476,100	2,472,900	2,468,700
準備預金残	2,216,200	2,223,600	2,227,300	2,256,400	2,250,800	2,240,800
レート	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07609%	0.07620%	0.07619%	0.07619%	0.07618%	0.07617%

10/28のマネタリーベース				3,442,700
10/28コール	合計	196,798	無担	64,048
			有担	132,750
コール前日増減	計	▲ 1,402	無担	▲ 453
			有担	▲ 949

10/29の加重平均レート(速報)				10/28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	
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.121 (0.077)				T/N		0.072 ~0.130 (0.085)		
				S/N		0.060 ~0.070 (0.061)		
				1W		0.098 (0.098)		
0.160 (0.160)				2W		0.073 ~0.310 (0.088)		
				3W				
0.070 ~0.140 (0.102)		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M		0.140 (0.140)		
		0.07-0.11	▲0.004-▲0.001	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.06-▲0.056	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	11/2	~	2/1 (91日間)	応札	525億円	落札	525億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	4,000億円	11/2		応札	10,593億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	0.005%	53.2%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	11/2		応札	14,313億円	落札	4,011億円	按分利回り較差	0.007%	93.5%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,000億円	11/2		応札	9,514億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	0.012%	72.6%	平均利回り較差	0.014%
T-Bill3M	応札19兆5,565億円	落札4兆3,652億円(非競争入札:3,947億円)	11/2~2016/2/8	▲0.0018%	按分	15.9838%	平均	▲0.0037%				
交付税特会	1兆500億円	11/12~2016/5/12	応札	3兆300億円	落札	1兆500億100万円	0.069%	按分	98.8890%	平均	0.068%	

「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録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