

<<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		100	▲ 200	▲ 1,000
財政		▲ 13,500	800	2,000
資金過不足		▲ 13,400	600	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		4,100	10,000	
95,169		▲ 4,000	▲ 11,700	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			22,500	
国庫短期証売却				
国債買入			10,600	2,900
CP等買入				
		▲ 200	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援				
3,255				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入			100	
国債補充供給				
小計		▲ 200	31,100	2,900
当預増減		▲ 13,600	31,700	3,900

当座預金残高	1,641,000	10/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,501,700		45,300
積み終了先	1,224,600	10/28以降の残り所要積立額	
超過準備	1,224,600	積数	39,600
非準備先残高	139,300	1日平均	2,100
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			1,920,500
準備預金進捗率	97.94% (実績)		38.71% (日数)

10/24のマナターベース		2,569,600	
10/24コール	合計	178,435	無担 71,504 有担 106,931
コール前日増減	計	▲ 2,645	無担 ▲ 790 有担 ▲ 1,855

10/27の加重平均レート(速報)			10/24の加重平均レート(確報)		
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
0.045 ~0.135 (0.059)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.045 ~0.135 (0.060)	
0.055 ~0.120 (0.073)				T/N	0.059 ~0.125 (0.086)
				S/N	
0.117 ~0.400 (0.121)				1W	0.055 ~0.117 (0.113)
0.118 ~0.145 (0.132)				2W	0.330 (0.330)
				3W	
0.118 ~0.145 (0.127)		0.08-0.12	-	1M	0.077 ~0.600 (0.087)
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.030-▲0.037	3M	
		-	-	6M	
		-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	1,100億円	10/29	応札	4,770億円	落札	1,108億円	按分利回り較差	-0.007%	40.5%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	350億円	10/29	応札	1,870億円	落札	351億円	按分利回り較差	-0.008%	80.2%	平均利回り較差	-0.008%
国債買入	1,400億円	10/29	応札	3,274億円	落札	1,400億円	按分価格較差	0.150円	10.0%	平均価格較差	0.013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

<< 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	1,672,700	前日比	31,700
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは、0.06%近辺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1兆2,000億円減少の123兆5,000億円(当座預金残高見込みは164兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.056~0.057%、大手行から0.05~0.055%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.057%程度となった。一巡後は、0.055~0.057%近辺での出合い。午後の取引は調整程度で一日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物を0.117%で調達を行った。

<< 27日のオープン市場動向 >>
CP現先レートS/N物は小幅低下となった。短国市場は、3M(489回)が▲0.03~▲0.037%で出合いが見られたものの、その他は動意なく閑散であった。CP市場は、引き合いペースで償還総額600億円弱に対し、発行総額は700億円程度にとどまった。発行レートは、概ね横ばい圏での動きとなっていた。

<< 28日の材料 >>
*9月の商業販売統計速報
*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
*2年利付国債入札(27,000億円、11/17発行)
*交付税特別会計借入(10,500億円、11/5借入)

JGB新発10年債	0.470	0.005	日経平均株価(終値)	15,388.72	97.08	為替(9時)	108.15-17
						為替(5時)	108.02-05

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	10/24	10/27
日銀当預残	1,652,000	1,654,600	1,660,900	1,648,600	1,654,600	1,641,000
準備預金残	1,508,600	1,522,100	1,520,800	1,514,900	1,516,800	1,501,700
レート	0.060%	0.060%	0.061%	0.060%	0.060%	0.059%
月中平均	0.05905%	0.05910%	0.05918%	0.05922%	0.05931%	0.05930%

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