

<<資金需給>>

単位 億円

	13日需給速報		14日需給予想	15日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		900	1,500	0
財政		▲ 55,200	5,300	54,000
資金過不足		▲ 54,300	6,800	54,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		600	9,100	
64,611		▲ 1,100	▲ 9,100	
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			12,300	4,700
CP等買入				
		▲ 400	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028				
被災地支援				
3,166				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 900	26,900	4,700
当預増減		▲ 55,200	33,700	58,700

<< 10/14の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,388,800	前日比	33,700
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。

<< 13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6兆2,000億円減の175兆8,000億円(当座預金残高見込みは235兆6,000億円)。無担O/Nは、新日銀ネット全面稼働日ということもあって調達を控える先が見られたものの、大手行・地銀・信託業態から0.075%前後での調達希望が始まるなど、先週末とほぼ同水準での立ち上がりとなった。まとまった金額に対しては引き続き0.07%台後半での出合いも散見されたが、一巡後はビッド水準が低下し、0.065~0.075%程度の出合いが散見される中で本日の取引を終えた。ターム物については、閑散であった。

<< 13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。短国市場は特段の出合いが見られず、閑散であった。CP市場は15日発行にあたり、石油、商社、建設業態でまとまった発行が見られ、発行総額は1,400億円程度となった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

<< 14日の材料 >>

- *月例経済報告
- *9月のマネーストック
- *9月の企業物価指数
- *米国ページブック
- *米国8月の企業在庫
- *米国9月の生産者物価指数
- *米国9月の小売売上高
- *5年利付国債入札 (25,000億円、10/16発行)
- *交付税特別会計借入 (10,500億円、10/22借入)

当座預金残高	2,355,100	10/13以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	2,141,400	10/14以降の残り所要積立額	0
積み終了先	1,761,000	積数	0
超過準備	1,761,000	1日平均	0
非準預先残高	213,700		
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額(積数)	1,960,800		
準備預金進捗率	100.00% (実績)	93.33% (日数)	

JGB新発10年債	0.315	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	18,234.74	▲ 203.93	為替(9時)	120.04-05
						為替(5時)	119.71-73

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	10/5	10/6	10/7	10/8	10/9	10/13
日銀当預残	2,374,700	2,394,700	2,409,100	2,406,100	2,410,300	2,355,100
準備預金残	2,162,200	2,177,800	2,188,200	2,186,700	2,190,100	2,141,400
レート	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%	0.075%	0.076%
月中平均	0.07620%	0.07633%	0.07629%	0.07638%	0.07592%	0.07592%

10/9のマネタリーベース				3,372,500		
10/9コール	合計	200,411	無担	68,572	有担	131,839
コール前日増減	計	3,386	無担	5,112	有担	▲ 1,726

10/13の加重平均レート(速報)				10/9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	0.055 ~0.080 (0.075)	
0.050 ~0.121 (0.077)					T/N		0.072 ~0.125 (0.083)		
					S/N				
					1W				
					2W				
0.114 ~0.210 (0.143)					3W				
					1M		0.145 ~0.230 (0.159)		有担先日付分
					2M				
					3M				
					6M				
					1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	700億円	10/15	応札	2,230億円	落札	700億円	按分利回り較差	0.000%	84.3%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	4,000億円	10/15	応札	15,579億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.003%	98.9%	平均利回り較差	-0.003%

「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