

<<資金需給>>

単位 億円

	14日需給速報		15日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,400	▲ 700	▲ 1,000
財政		5,500	50,000	▲ 26,000
資金過不足		6,900	49,300	▲ 27,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		9,100		
64.612		▲ 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	4,800	
CP等買入				
		▲ 400	▲ 600	
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			200	
国債補完供給				
小計		26,900	4,400	0
当預増減		33,800	53,700	▲ 27,000

<< 10/15の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,442,600	前日比	53,700
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。

<< 14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3兆1,000億円増の178兆9,000億円(当座預金残高見込みは238兆9,000億円)。無担O/Nは昨日に引き続き、大手行・地銀・信託業態から0.075~0.076%前後での調達が行われた。まとまった金額に対しては0.077~0.078%近辺での出合いも散見されたが、徐々に出合い水準は低下し、最終的には0.065~0.07%近辺での出合いで本日の取引を終えた。ターム物の出合いは閑散であった。

<< 14日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は入札を控えた調整売りからか、3Mが▲0.005%での出合いから始まり、最終的には▲0.002%での出合いが見られていた。CP市場は入札件数・発行額共に少なく総額600億円程度の出合いと閑散。発行レートは概ね横ばいで推移した。

<< 15日の材料 >>
 *8月のマネタリーサーベイ
 *8月の第3次産業活動指数
 *8月の石油等消費動態統計
 *米国9月の消費者物価指数
 *国庫短期証券入札(3か月、48,000億円、10/19発行)

当座預金残高	2,388,900	10/14以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	2,166,300	10/15以降の残り所要積立額	0
積み終了先	1,783,400	積数	0
超過準備	1,783,400	1日平均	0
非準預先残高	222,600		
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) 96.67% (日数)

JGB新発10年債	0.305	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,891.00	▲ 343.74	為替(9時)	119.73-74
						為替(5時)	119.60-62

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	10/6	10/7	10/8	10/9	10/13	10/14
日銀当預残	2,394,700	2,409,100	2,406,100	2,410,300	2,355,100	2,388,900
準備預金残	2,177,800	2,188,200	2,186,700	2,190,100	2,141,400	2,166,300
レート	0.077%	0.076%	0.077%	0.075%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07633%	0.07629%	0.07638%	0.07592%	0.07592%	0.07593%

10/13のマネタリーベース		3,316,400	
10/13コール合計	197,482	無担	66,077
有担	131,405		
コール前日増減	計 ▲ 2,929	無担 ▲ 2,495	有担 ▲ 434

10/14の加重平均レート(速報)				10/13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	
0.065 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.070 ~0.121 (0.079)				T/N	0.050 ~0.121 (0.077)			
				S/N				
0.070 ~0.130 (0.104)				1W				
0.310 (0.310)				2W	0.114 ~0.210 (0.143)			
0.140 (0.140)				3W				
0.078 (0.078)		0.07-0.12	-	1M				有担先日付分
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.005-▲0.002	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オベ情報、入札結果>>

社債買入 1,250億円 10/20 応札 2,009億円 落札 1,250億円 按分レート 0.065% 55.4% 平均落札レート 0.096%
 米ドル資金供給(固定金利方式) 10/16~10/22 (6日間) 応札なし 貸付利率 0.620%
 5年利付国債(表面利率0.1%) 応札6兆4,572億円 落札2兆3,166億円(I非競争入札:1,825億円) 10/16~2020/9/20 0.055% 按分72.6847% 平均0.053%
 交付税特会 1兆500億円 10/22~2016/4/22 応札2兆9,180億円 落札1兆500億円 0.074% 按分20.5000% 平均0.071%
 ETF買入 336億円 約定日 10/14

「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