

**<<資金需給>>**

単位 億円

	16日需給速報		19日需給予想	20日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	100	0
財政		▲ 23,000	4,400	▲ 18,000
資金過不足		▲ 23,900	4,500	▲ 18,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			2,000	
64,612			▲ 1,000	
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			12,000	
CP等買入				
		▲ 400	▲ 100	
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		▲ 400		1,300
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 800	12,900	1,300
当預増減		▲ 24,700	17,400	▲ 16,700

当座預金残高	2,417,900	10/16以降の残り所要積立額	2,019,500
準備預金残高	2,199,000	10/19以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,739,100	積数	130,800
超過準備	1,172,000	1日平均	4,700
非準預先残高	218,900	積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)	2,019,500
準備預金進捗率	93.52% (実績)		9.68% (日数)

10/15のマナターベース		3,403,300	
10/15コール合計	195,640	無担	60,128
コール前日増減	計	527	無担 ▲ 1,846
			有担 2,373

10/16の加重平均レート(速報)				10/15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	単位(%)	
0.065 ~0.125 (0.077)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.060 ~0.125 (0.076)
0.070 ~0.121 (0.080)						T/N	0.050 ~0.121 (0.078)
						S/N	
						1W	
						2W	
						3W	
0.140 ~0.280 (0.163)				0.07-0.12	-	1M	0.140 (0.140)
				0.07-0.11	-	2M	0.630 (0.630)
				0.07-0.11	▲0.01	3M	
				-	-	6M	
				-	▲0.07-▲0.0358	1Y	

**<<オペ情報、入札結果>>**

T-Bill1Y 応札9兆3,746億円 落札2兆2,865億9,000万円(非競争入札:2,134億円) 10/20~2016/10/20 ▲0.0358% 按分27.6323% 平均▲0.0418%  
流動性供給 応札1兆8,644億円 落札 4,987億円 10/20 募入最大利回較差 ▲0.001% 按分 14.2174% 募入平均利回較差 ▲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

<< 10/19の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,435,300	前日比	17,400
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。

**<< 16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2兆円減の180兆3,000億円(当座預金残高見込みは241兆8,000億円)。積みの初日となる本日の無担O/Nは、地銀・信託業態を中心に0.075~0.076%近辺の調達希望で始まった。週末を挟むことで小幅上昇し、まとまった金額に対しては0.078~0.079%での出合いも一部で見られた。一巡後は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。

**<< 16日のオープン市場動向 >>**

現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は1Y物の入札が実施された。短国買入オペを睨んでか、結果は平均落札利回▲0.0418%、最高落札利回▲0.0358%と過去最低を更新する非常に強い入札となった。セカンドリーは▲0.07~▲0.05%の出合い。CP市場は20日発行となり電機、商社業態等からまとまった発行が見られ、発行総額は1,900億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移した。

**<< 19日の材料 >>**

\*日銀支店長会議、さくらレポート(地域経済報告)  
\*中国7-9月期のGDP

<<コール9月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07457%	有担 0.03090%
(営業日のみ)	無担	0.07339%	有担 0.03083%

JGB新発10年債	0.315	0.000	日経平均株価(終値)	18,291.80	194.90	為替(9時)	119.08-09
						為替(5時)	119.12-14

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	10/8	10/9	10/13	10/14	10/15	10/16
日銀当預残	2,406,100	2,410,300	2,355,100	2,388,900	2,442,600	2,417,900
準備預金残	2,186,700	2,190,100	2,141,400	2,166,300	2,217,500	2,199,000
レート	0.077%	0.075%	0.076%	0.076%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07638%	0.07592%	0.07592%	0.07593%	0.07593%	0.07611%

10/16の加重平均レート(速報)				10/15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	単位(%)	
0.065 ~0.125 (0.077)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.060 ~0.125 (0.076)
0.070 ~0.121 (0.080)						T/N	0.050 ~0.121 (0.078)
						S/N	
						1W	
						2W	
						3W	
0.140 ~0.280 (0.163)				0.07-0.12	-	1M	0.140 (0.140)
				0.07-0.11	-	2M	0.630 (0.630)
				0.07-0.11	▲0.01	3M	
				-	-	6M	
				-	▲0.07-▲0.0358	1Y	

**<<オペ情報、入札結果>>**

T-Bill1Y 応札9兆3,746億円 落札2兆2,865億9,000万円(非競争入札:2,134億円) 10/20~2016/10/20 ▲0.0358% 按分27.6323% 平均▲0.0418%  
流動性供給 応札1兆8,644億円 落札 4,987億円 10/20 募入最大利回較差 ▲0.001% 按分 14.2174% 募入平均利回較差 ▲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