

<<資金需給>>

単位 億円

	23日需給速報		26日需給予想	27日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,000	100	0
財政		1,500	6,000	0
資金過不足		▲ 500	6,100	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			3,300	
65,632			▲ 2,800	
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		8,000		12,000
CP等買入				
		▲ 300	▲ 700	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028				
被災地支援		100		
3,161		▲ 100		
社債等買入		▲ 400	▲ 100	
ETF買入		200		
国債補完供給				
小計		7,500	▲ 300	27,000
当預増減		7,000	5,800	27,000

<< 10/26の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,446,500	前日比	5,800
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。					

<< 23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1兆1,000億円増の182兆8,000億円(当座預金残高見込みは244兆2,000億円)。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。週末要因によりビッド水準は底堅く、立ち上がりは0.076~0.078%での出合いであった。一巡後は0.07~0.075%近辺の出合いで本日の取引を終えた。タム物は証券業態のロール案件が散見された。

<< 23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、3M物が▲0.002% 1Y物が▲0.048~▲0.047%で出合いがみられた。また、短国買入オペが前回と同額の15,000億円でオファーされた。落札結果は、平均利回較差+0.009% 按分利回較差+0.003%と落ち着いた結果となった。CP市場は、発行・償還総額とも100億円程度にとどまった。発行レートは横ばい圏の動き。

<< 26日の材料 >>
 *9月の米新築一戸建て販売件数

当座預金残高	2,440,700	10/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,223,600		35,200
積み終了先	1,819,000	10/26以降の残り所要積立額	
超過準備	1,815,800	積数	13,400
非準備先残高	217,100	1日平均	600
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	99.34% (実績)		32.26% (日数)

JGB新発10年債	0.300	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	18,825.30	389.43	為替(9時)	120.89-90
						為替(5時)	120.34-36

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	10/16	10/19	10/20	10/21	10/22	10/23
日銀当預残	2,417,900	2,431,700	2,416,400	2,446,600	2,433,700	2,440,700
準備預金残	2,199,000	2,211,200	2,189,300	2,215,200	2,216,200	2,223,600
レート	0.077%	0.076%	0.076%	0.076%	0.076%	0.077%
月中平均	0.07611%	0.07611%	0.07610%	0.07610%	0.07609%	0.07620%

10/22のマネタリーベース				3,399,900
10/22コール	合計	189,488	無担	55,617
			有担	133,871
コール前日増減	計	▲ 309	無担	▲ 111
			有担	▲ 198

10/23の加重平均レート(速報)				10/22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		
0.060 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.072 ~0.121 (0.081)				T/N		0.075 ~0.125 (0.082)		
				S/N		0.125 (0.125)		
0.100 (0.100)				1W		0.098 ~0.117 (0.117)		
0.075 ~0.145 (0.081)				2W		0.160 (0.160)		
				3W				
		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M		0.125 (0.125)		
		0.07-0.11	▲ 0.002	3M				
		-	-	6M				
		-	▲ 0.048-▲ 0.047	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	15,000億円	10/27	応札	28,570億円	落札	15,001億円	按分利回り較差	0.003%	71.9%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	4,000億円	10/27	応札	12,676億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	0.005%	99.8%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	10/27	応札	14,302億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	-0.003%	70.1%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	4,000億円	10/27	応札	14,360億円	落札	4,009億円	按分利回り較差	-0.003%	54.1%	平均利回り較差	-0.002%

「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