

**<<資金需給>>**

単位 億円

	6日需給速報		7日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	0	1,000
財政		700	▲ 22,200	▲ 30,000
資金過不足		900	▲ 22,200	▲ 29,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			12,700	2,400
81,930			▲ 10,100	▲ 4,000
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		15,200		15,000
CP等買入			▲ 300	
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				
国債補完供給	即日	▲ 200	200	
小計		37,500	2,400	13,400
当預増減		38,400	▲ 19,800	▲ 15,600

当座預金残高	1,695,100	11/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,546,400		15,300
積み終了先	1,280,900	11/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,280,900	積数	13,200
非準預先残高	148,700	1日平均	1,500
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			1,921,100
準備預金進捗率	99.31% (実績)	70.97% (日数)	

11/5のマネタリーベース		2,573,000	
11/5コール	合計	172,583	無担 62,869 有担 109,714
コール前日増減	計	3,093	無担 728 有担 2,365

11/6の加重平均レート(速報)				11/5の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.030 ~0.135 (0.061)	0.030	~0.040 (0.031)		0.030 ~0.135 (0.061)		0.065 ~0.120 (0.100)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.057 ~0.120 (0.069)								
0.070 ~0.117 (0.087)						0.083 ~0.120 (0.105)		
0.116 (0.116)						0.118 (0.118)		
0.118 (0.118)								
		0.08-0.12	-			0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-					
0.118 (0.118)		0.08-0.12	0.008-0.0175					
		-	0.01-0.017					
		-	-					

<< 11/7の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,675,300	前日比	▲ 19,800
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.055~0.06%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 6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3兆5,000億円増加の129兆2,000億円(当座預金残高見込みは169兆5,000億円)。無担O/Nは、地銀・信託業態から0.057~0.058%、大手行から0.055%での調達希望で立ち上がり、出合いの中心レートは0.057~0.058%近辺となった。一巡後は0.055~0.058%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。共通担保オペが8,000億円オファーされ、結果は落札総額2,360億円となり、期落ち分の4,040億円を下回った。

<< 6日のオープン市場動向 >>  
 短国現先レートS/Nは発行日要因から前日比でやや上昇した。短国アウトライ市場は3Mが0.008~0.0175%、6Mが0.01~0.017%の出合い。短国3M物の入札は、按分落札利回0.0204%、平均落札利回0.0163%、按分比率74.1769%という結果だった。CP市場は10日発行にあたり、償還総額1,700億円程度に対して発行総額1,400億円程度となった。発行レートは横ばい圏で推移した。

<< 7日の材料 >>  
 \*米国9月の消費者信用残高  
 \*米国10月の雇用統計  
 \*流動性供給入札(3,000億円、11/11発行)

<<コール10月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.05929%	有担 0.03035%
(営業日のみ)	無担	0.05900%	有担 0.03055%

JGB新発10年債	0.470	0.005	日経平均株価(終値)	16,792.48	▲ 144.84	為替(9時)	114.65-66
						為替(5時)	114.45-46

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	10/29	10/30	10/31	11/4	11/5	11/6
日銀当預残	1,674,200	1,672,600	1,677,000	1,656,000	1,656,700	1,695,100
準備預金残	1,527,000	1,528,500	1,540,700	1,518,700	1,518,900	1,546,400
レート	0.059%	0.059%	0.060%	0.061%	0.061%	0.061%
月中平均	0.05928%	0.05927%	0.05929%	0.06025%	0.06040%	0.06050%

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	11/10	~ 2/9 (91日間)	応札	2,360億円	落札	2,360億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	2,000億円	11/6	~ 11/7 (1日間)	応札	199億円	落札	199億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	5,500億円	11/10		応札	12,391億円	落札	5,505億円	按分利回り較差	0.012%	65.9%	平均利回り較差	0.012%
国債買入	5,500億円	11/10		応札	13,205億円	落札	5,501億円	按分利回り較差	0.006%	89.6%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,000億円	11/10		応札	11,552億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.006%	96.9%	平均利回り較差	0.010%

T-Bill3M 応札27兆4,229億円 落札5兆2,947億円(非競争入札:4,152億円) 11/10~2015/2/16 0.0204% 按分74.1769% 平均0.0163%  
 J-REIT買入 12億円 約定日 11/6

「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