

<<資金需給>>

単位 億円

	7日需給速報		10日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	1,100	2,000
財政		▲ 22,200	▲ 33,600	▲ 1,000
資金過不足		▲ 22,000	▲ 32,500	1,000
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	12,800
84,580		▲ 10,100	▲ 4,000	▲ 12,900
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				27,500
国庫短期証売却				
国債買入			15,100	
CP等買入				
		▲ 300	▲ 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	▲ 100		
		200	100	
小計		2,300	13,300	27,400
当預増減		▲ 19,700	▲ 19,200	28,400

当座預金残高	1,675,400	11/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,540,200		13,200
積み終了先	1,276,100	11/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,276,100	積数	4,800
非準預先残高	135,200	1日平均	800
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			1,929,200
準備預金進捗率	99.75% (実績)	80.65% (日数)	

11/6のマネタリーベース		2,611,200	
11/6コール 合計	180,822	無担	71,727
		有担	109,095
コール前日増減	計 8,239	無担	8,858
		有担	▲ 619

11/7の加重平均レート(速報)				11/6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
0.050 ~0.135 (0.062)	0.030	~0.040 (0.031)		O/N	0.030 ~0.135 (0.061)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.056 ~0.120 (0.076)				T/N		0.057 ~0.120 (0.069)		
				S/N				
0.088 (0.088)				1W		0.070 ~0.117 (0.087)		
0.310 (0.310)				2W		0.116 (0.116)		
0.071 (0.071)				3W		0.118 (0.118)		
				1M				有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	-	3M	0.118 (0.118)	0.119 (0.119)		
		0.08-0.12	▲0.003-0.006	6M				
		-	0.002-0.01	1Y				
		-	-					

11/10の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,656,200	前日比	▲ 19,200
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。

<< 7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2兆円減少の127兆2,000億円(当座預金残高見込みは167兆5,000億円)。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0.058%近辺となった。一巡後は0.055~0.057%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関しては、ロール案件中心の取引となった。3M物の共通担保オペが2兆円オファーされ、結果は落札総額1兆2,800億円となり、期落ち分の1兆2,880億円とほぼ同額となった。

<< 7日のオープン市場動向 >>
 短国現先レートS/Nは短国買入オペの影響で前日比やや低下した。短国アウトライト市場は3Mが▲0.003~0.006%、6Mが0.002~0.01%の出合い。短国買入オペは2兆7,500億円で通知され、按分利回較差▲0.008%、平均利回較差▲0.005%、按分比率87.8%という結果だった。CP市場は償還総額1,400億円程度に対して発行総額は700億円程度。証券銘柄で大口の発行案件があったものの、発行レートは横ばい圏での推移となった。CP等買入オペが4,000億円通知され、按分レート0.051%、平均レート0.079%、按分比率73.1%という結果だった。なお、今回のオペから応札方式が変更され、銘柄毎に指値を行う方式となった。これまでの結果と比べて、按分と平均の差が拡大したことに寄与したものとみられる。

<< 10日の材料 >>
 *10月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *米国10月のFRB労働市場情勢指数

《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	0.475	0.005	日経平均株価(終値)	16,880.38	87.90	為替(9時)	115.17-20
						為替(5時)	115.27-28

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	10/30	10/31	11/4	11/5	11/6	11/7
日銀当預残	1,672,600	1,677,000	1,656,000	1,656,700	1,695,100	1,675,400
準備預金残	1,528,500	1,540,700	1,518,700	1,518,900	1,549,300	1,540,200
レート	0.059%	0.060%	0.061%	0.061%	0.061%	0.062%
月中平均	0.05927%	0.05929%	0.06025%	0.06040%	0.06050%	0.06100%

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	20,000億円	11/11 ~ 2/20 (101日間)	応札 12,800億円	落札 12,800億円	0.100%	全取	平均 0.100% (固定)
国債補完	4,000億円	11/7 ~ 11/10 (3日間)	応札 55億円	落札 55億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債補完	2,000億円	11/7 ~ 11/10 (3日間)	応札 47億円	落札 47億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国短買入	27,500億円	11/11	応札 33,055億円	落札 27,502億円	-0.008%	87.8%	平均利回り較差 -0.005%
CP買入	4,000億円	11/12	応札 7,386億円	落札 3,995億円	按分レート 0.051%	73.1%	平均落札レート 0.079%

流動性供給 応札 9,499億円 落札 2,994億円 11/11 募入最大利回較差 0.011% 按分 83.5664% 募入平均利回較差 0.009%

「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