

◀資金需給▶

単位 億円

	11日需給速報		12日需給予想		13日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		800	500	0		
財政		▲ 3,200	▲ 1,200	▲ 4,000		
資金過不足		▲ 2,400	▲ 700	▲ 4,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		12,800				
82,820		▲ 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			15,200			
CP等買入			4,000			
		▲ 100	▲ 400			
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						
ETF買入						
国債補完供給		200				
小計		27,500	18,800	0		
当預増減		25,100	18,100	▲ 4,000		

当座預金残高	1,680,800	11/11以降の残り所要積立額	2,800
準備預金残高	1,537,300	11/12以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,275,200	積数	1,500
超過準備	1,275,100	1日平均	400
非準備先残高	143,500	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	99.92% (実績)		87.10% (日数)

11/10のマナタリーベース		2,570,500	
11/10コール 合計	190,134 無担	80,157 有担	109,977
コール前日増減 計	10,991 無担	12,650 有担	▲ 1,659

11/11の加重平均レート(速報)				11/10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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	単位(%)
0.045 ~0.135 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.030 ~0.135 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.058 ~0.120 (0.068)				T/N			
				S/N	0.060 ~0.120 (0.069)		
				1W	0.125 ~0.400 (0.187)		
0.250 (0.250)				2W	0.143 ~0.160 (0.157)		
				3W			
		0.08-0.12	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.007	3M	0.265 (0.265)		
		-	▲0.005	6M			
		-	-	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

30年利付国債(表面利率1.7%) 応札1兆6,736億円 落札5,534億円(I非競争入札:461億円) 11/13~2044/9/20 1.489% 按分60.6349% 平均1.483%  
 交付税特会 1兆500億円 11/19~2015/5/18 応札3兆704億円 落札1兆500億円 0.094% 按分23.4000% 平均0.090%

「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

◀ 11/12の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,698,900	前日比	18,100
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。

◀ 11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3兆円増加の128兆2,000億円(当座預金残高見込みは168兆1,000億円)。無担O/Nは、地銀・信託業態から0.059~0.06%、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0.059%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、昨日に引き続き一部業態からストレスチェックと思われる調達も行われつつ、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。

◀ 11日のオープン市場動向 ▶  
 現先レートは低位横ばいでの推移となった。短国市場は引き続き閑散な状態が続いており、3M▲0.007%、6M▲0.005%で少額の出合いが見られるにとどまった。CP市場は入札件数・発行額共に少なく、発行総額750億円程度と閑散であった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

◀ 12日の材料 ▶  
 \*宮尾日銀審議委員、長崎県金融経済懇談会にて講演  
 \*佐藤日銀審議委員、ジャパン・ソサエティ(ロンドン)にて講演  
 \*9月の第3次産業活動指数 \*10月のマネーストック  
 \*米国9月の卸売売上高

JGB新発10年債	0.490	0.035	日経平均株価(終値)	17,124.11	343.58	為替(9時)	114.80-81
						為替(5時)	115.79-80

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	11/4	11/5	11/6	11/7	11/10	11/11
日銀当預残	1,656,000	1,656,700	1,695,100	1,675,400	1,655,700	1,680,800
準備預金残	1,518,700	1,518,900	1,549,300	1,541,800	1,515,700	1,537,300
レート	0.061%	0.061%	0.061%	0.062%	0.068%	0.068%
月中平均	0.06025%	0.06040%	0.06050%	0.06100%	0.06170%	0.06227%