

<<資金需給>>

単位 億円

	30日需給速報		2日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300	100	1,000
財政		▲ 1,400	▲ 15,600	▲ 10,000
資金過不足		▲ 2,700	▲ 15,500	▲ 9,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			500	
66,122			▲ 1,100	
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		5,400	12,100	
CP等買入		4,000		
		▲ 3,300	▲ 500	
貸出支援基金				
(成長) 51,505				
(増加) 252,028				
被災地支援				
3,161				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 300	300	
小計		5,800	11,300	0
当預増減		3,100	▲ 4,200	▲ 9,000

<< 11/2の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,467,600	前日比	▲ 4,200
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。

<< 30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5,000億円減の184兆7,000億円(当座預金残高見込みは247兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態を中心に0.07~0.075%近辺の調達希望と前日に比べて低下基調で始まったが、大手行の0.075%の調達希望が見られたことで徐々に取り上がりとなり、0.075%を中心とした出合いで始まった。一巡後は取り下がり0.07%近辺の出合で本日の取引を終えた。ターム物は大手行から2Wで大規模な調達が見られた。

<< 30日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、政策決定会合の後も特段目立った動き等は見られず。閑散とした地合の中、3Mで▲0.001%近辺での取引が見られる程度であった。CP市場は、食品業態からの大型発行案件が見られたものの、発行総額は700億円弱程とあまり膨らまなかった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

<< 2日の材料 >>

- *米国9月の建設支出
- *米国10月のISM製造業景況指数
- *流動性供給入札(3,000億円、11/5発行)

<<コール10月の加重平均レート>>

(土日を含む)	無担	0.07603%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07610%	有担	0.03100%

当座預金残高	2,471,800	10/30以降の残り所要積立額	6,100
準備預金残高	2,244,000	11/2以降の残り所要積立額	4,700
積み終了先	1,847,100	積数	300
超過準備	1,847,000	1日平均	300
非準備先残高	227,800		
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)	2,019,100		
準備預金進捗率	99.77% (実績)	54.84% (日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	121.04-05
0.295	0.005	19,083.10	147.39
		為替(5時)	120.73-75

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	10/23	10/26	10/27	10/28	10/29	10/30
日銀当預残	2,440,700	2,446,200	2,476,100	2,472,900	2,468,700	2,471,800
準備預金残	2,223,600	2,227,300	2,256,400	2,250,800	2,240,800	2,244,000
レート	0.077%	0.076%	0.076%	0.076%	0.076%	0.074%
月中平均	0.07620%	0.07619%	0.07619%	0.07618%	0.07617%	0.07603%

10/29のマネタリーベース				3,439,900		
10/29コール	合計	198,960	無担	64,163	有担	134,797
コール前日増減	計	2,162	無担	115	有担	2,047

10/30の加重平均レート(速報)				10/29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	有担先日付分	
0.050 ~0.080 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.121 (0.080)				T/N		0.050 ~0.121 (0.073)		
				S/N				
0.098 ~0.117 (0.108)				1W				
0.118 ~0.340 (0.118)				2W		0.160 (0.160)		
				3W				
0.140 (0.140)		0.07-0.12	-	1M		0.070 ~0.140 (0.102)	有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.001	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペア情報、入札結果>>

国債補完 1,000億円 10/30 ~ 11/2 (3日間) 応札 275億円 落札 275億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

<<日銀金融政策決定会合・結果>>

・マネタリーベースが、年間約80兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(賛成8反対1)

・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)

- ①長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。買入れの平均残存期間は7年~10年程度とする。
- ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約3兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
- ③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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