

**<<資金需給>>**

単位 億円

|                    | 2日需給速報 |          | 4日需給予想   | 5日当社予想  |
|--------------------|--------|----------|----------|---------|
|                    | 即日     | 金額       | 金額       | 金額      |
| 銀行券                |        | ▲ 100    | 900      | 0       |
| 財政                 |        | ▲ 18,700 | ▲ 13,400 | ▲ 2,000 |
| 資金過不足              |        | ▲ 18,800 | ▲ 12,500 | ▲ 2,000 |
| 貸出                 |        |          |          |         |
| 売出手形               |        |          |          |         |
| 0                  |        |          |          |         |
| 本店共通               |        |          |          |         |
| 0                  |        |          |          |         |
| 全店共通               |        |          |          |         |
| 0                  |        |          |          |         |
| 共通(固定)             |        | 500      |          |         |
| 65,582             |        | ▲ 1,100  |          |         |
| 国債買現               |        |          |          |         |
| 0                  |        |          |          |         |
| CP買現               |        |          |          |         |
| 0                  |        |          |          |         |
| 国庫短期証買入            |        |          |          | 7,500   |
| 国庫短期証売却            |        |          |          |         |
| 国債買入               |        | 12,100   |          |         |
| CP等買入              |        | ▲ 500    | ▲ 100    |         |
| 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              |        |          |          |         |
| 国債補充供給             |        | 300      |          |         |
| 小計                 |        | 11,300   | ▲ 100    | 7,500   |
| 当預増減               |        | ▲ 7,500  | ▲ 12,600 | 5,500   |

|                             |             |                |       |
|-----------------------------|-------------|----------------|-------|
| 当座預金残高                      | 2,464,300   | 11/2以降の残り所要積立額 | 4,700 |
| 準備預金残高                      | 2,237,900   |                |       |
| 積み終了先                       | 1,840,300   | 11/4以降の残り所要積立額 | 4,200 |
| 超過準備                        | 1,840,300   | 積数             | 300   |
| 非準備先残高                      | 226,400     | 1日平均           | 300   |
| 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                     | 99.79% (実績) | 61.29% (日数)    |       |

| 10/30のマネタリーベース |    | 3,444,300 |                      |
|----------------|----|-----------|----------------------|
| 10/30コール       | 合計 | 194,207   | 無担 58,169 有担 136,038 |
| コール前日増減        | 計  | ▲ 4,753   | 無担 ▲ 5,994 有担 1,241  |

| 11/2の加重平均レート(速報)     |       |                |  | 10/30の加重平均レート(確報)    |                      |                      |  |
|----------------------|-------|----------------|--|----------------------|----------------------|----------------------|--|
| 無担(平均)               |       | 有担(平均)         |  | 無担当日分                |                      | 有担当日分                |  |
| 0.030 ~0.125 (0.076) | 0.030 | ~0.040 (0.031) |  | 0.050 ~0.080 (0.074) |                      | 0.030 ~0.040 (0.031) |  |
| 0.072 ~0.121 (0.078) |       |                |  |                      | 0.065 ~0.121 (0.080) |                      |  |
| 0.076 (0.076)        |       |                |  |                      | 0.098 ~0.117 (0.108) |                      |  |
| 0.118 ~0.165 (0.119) |       |                |  |                      | 0.118 ~0.340 (0.118) |                      |  |
| 0.116 (0.116)        |       |                |  |                      |                      |                      |  |
| 0.116 ~0.170 (0.125) |       |                |  |                      | 0.140 (0.140)        | 有担先日付分               |  |
|                      |       |                |  |                      |                      |                      |  |
|                      |       |                |  |                      |                      |                      |  |
|                      |       |                |  |                      |                      |                      |  |
|                      |       |                |  |                      |                      |                      |  |
|                      |       |                |  |                      |                      |                      |  |
|                      |       |                |  |                      |                      |                      |  |
|                      |       |                |  |                      |                      |                      |  |

**<<オペ情報、入札結果>>**

国短買入 7,500億円 11/5 応札 15,072億円 落札 7,504億円 按分利回り較差 0.000% 73.8% 平均利回り較差 0.005%  
 流動性供給 応札 8,364億円 落札 2,984億円 11/5 募入最大利回り較差 0.018% 按分 17.4666% 募入平均利回り較差 0.015%  
 ETF買入 336億円 約定日 11/2  
 J-REIT買入 12億円 約定日 11/2

「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

| << 11/4の日銀調節とレート予想 >>                |           |        |           |     |           |
|--------------------------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節                                 | 見送り       | 当座預金残高 | 2,451,700 | 前日比 | ▲ 12,600  |
| 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。 |           |        |           |     |           |

<< 2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7,000億円減少の184兆円(当座預金残高見込みは246兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.075%近辺、地銀・信託業態から0.075~0.077%近辺の調達希望。立ち上がりは0.075~0.077%近辺の出合いが中心となった。一巡後は0.075%を中心とした出合いで推移した。ターム物は、大手行から2W物の期間でまとまった調達が見られた。

<< 2日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは、同水準で推移した。短国市場は、短国買入オペが前回比7,500億円減額の7,500億円でおファーされた。落札結果は、平均利回較差+0.005% 按分利回較差+0.000%と、買入額が減額された影響も特段見られず、落ち着いた結果となった。後場は3M▲0.002~▲0.001%、1Y▲0.05%での出合いが見られた。CP市場は償還総額1,700億円程度に対し、発行総額は1,000億円程度。発行レートは、一部に強めの決着も見られたものの、概ね横ばい圏での動きとなった。

<< 3日の材料 >>  
 \*米国9月の製造業新規受注・出荷・在庫

<< 4日の材料 >>  
 \*10月のマネタリーベース  
 \*10月の消費動向調査  
 \*10月実績/11月見込み財政資金対民間収支  
 \*米国9月の貿易収支  
 \*米国10月のISM非製造業景況指数

| <<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% |

|           |       |       |            |           |          |        |           |
|-----------|-------|-------|------------|-----------|----------|--------|-----------|
| JGB新発10年債 | 0.305 | 0.010 | 日経平均株価(終値) | 18,683.24 | ▲ 399.86 | 為替(9時) | 120.51-53 |
|           |       |       |            |           |          | 為替(5時) | 120.45-47 |

| 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                             | 10/26     | 10/27     | 10/28     | 10/29     | 10/30     | 11/2      |
| 日銀当預残                          | 2,446,200 | 2,476,100 | 2,472,900 | 2,468,700 | 2,471,800 | 2,464,300 |
| 準備預金残                          | 2,227,300 | 2,256,400 | 2,250,800 | 2,240,800 | 2,244,200 | 2,237,900 |
| レート                            | 0.076%    | 0.076%    | 0.076%    | 0.076%    | 0.074%    | 0.076%    |
| 月中平均                           | 0.07619%  | 0.07619%  | 0.07618%  | 0.07617%  | 0.07603%  | 0.07533%  |