

<<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想		6日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,200		700		0
財政		▲ 15,800		7,100		2,000
資金過不足		▲ 14,600		7,800		2,000
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		65,582				
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						11,800
国債買入						11,800
CP等買入		▲ 100		▲ 600		
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	▲ 200		200		
小計		▲ 300		7,100		11,800
当増増減		▲ 14,900		14,900		13,800

11/5の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,464,300	前日比	14,900
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。					

<< 4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9,000億円減少の183兆1,000億円(当座預金残高見込みは245兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行から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。一巡後は0.075%を中心とした出合いで推移したが、一部で試し取りと見られる0.12%近辺での出合いも見られた。ターム物は、大手行から1W物の期間でまとまった調達が確認された。

<< 4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、閑散な地合の中、3Mにおいて▲0.004~▲0.003%での散発的な出合いが見られた。CP市場は、償還総額850億円程度に対し、発行総額は500億円程度と閑散。発行レートは、最上格銘柄で0.05~0.06%台の約定が観測されるなど、一部では強まったものの、全体として見れば横ばい圏での推移となった。

<< 5日の材料 >>

- *11月の日銀当座預金増減要因見込み
- *日銀金融政策決定会合議事要旨(10月6、7日開催分)
- *英中銀MPC結果発表
- *国庫短期証券入札(3か月、48,000億円、11/9発行)
- *10年利付国債入札(24,000億円、11/9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	2,449,400	11/4以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,229,600		4,200
積み終了先	1,827,700	11/5以降の残り所要積立額	
超過準備	1,827,700	積数	3,900
非準備先残高	219,800	1日平均	400
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	99.81%	(実績)	64.52%
		(日数)	

JGB新発10年債	0.310	0.005	日経平均株価(終値)	18,926.91	243.67	為替(9時)	121.08-10
						為替(5時)	121.10-12

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	10/27	10/28	10/29	10/30	11/2	11/4
日銀当座預金	2,476,100	2,472,900	2,468,700	2,471,800	2,464,300	2,449,400
準備預金残	2,256,400	2,250,800	2,240,800	2,244,200	2,237,900	2,229,600
レート	0.076%	0.076%	0.076%	0.074%	0.076%	0.085%
月中平均	0.07619%	0.07618%	0.07617%	0.07603%	0.07533%	0.07775%

11/4の加重平均レート(速報)				11/2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		有担当日分
0.060 ~0.125 (0.085)	0.030	~0.040 (0.031)			O/N	0.030 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.130 (0.079)					T/N		0.072 ~0.130 (0.079)	
0.077 (0.077)					S/N		0.076 (0.076)	
0.098 ~0.123 (0.116)					1W		0.118 ~0.165 (0.118)	
0.310 (0.310)					2W		0.116 (0.116)	
					3W		0.116 ~0.170 (0.125)	
					1M			有担先日付分
					2M			
					3M			
					6M			
					1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,000億円	11/4	~ 11/5 (1日間) 応札	184億円	落札	184億円	-0.400%	全取	平均	-0.400%(即)	
国債買入	4,000億円	11/6	応札	12,914億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.004%	99.6%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	11/6	応札	13,384億円	落札	4,012億円	按分利回り較差	0.002%	22.7%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	2,400億円	11/6	応札	9,829億円	落札	2,405億円	按分利回り較差	0.009%	85.4%	平均利回り較差	0.011%
国債買入	1,400億円	11/6	応札	4,813億円	落札	1,407億円	按分利回り較差	0.006%	73.1%	平均利回り較差	0.007%

米ドル資金供給(固定金利方式) 11/6~11/13 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.630%

J-REIT買入 14億円 約定日 11/4

「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の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