

<<資金需給>>

単位 億円

	5日需給速報		6日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		900	400	1,000
財政		7,300	9,000	▲ 26,000
資金過不足		8,200	9,400	▲ 25,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		65,582		1,700 ▲ 2,400
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証券買入		7,500		
国庫短期証券売却				
国債買入			12,100	
CP等買入		▲ 600	▲ 300	
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		200		
小計		7,100	11,800	▲ 700
当預増減		15,300	21,200	▲ 25,700

当座預金残高	2,464,700	11/5以降の残り所要積立額	3,900
準備預金残高	2,242,600	11/6以降の残り所要積立額	3,500
積み終了先	1,841,000	積数	300
超過準備	1,841,000	1日平均	300
非準備先残高	222,100	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	99.83% (実績)		67.74% (日数)

11/4のマナターベース		3,420,800	
11/4コール 合計	214,142	無担	79,621
コール前日増減	計	10,728	無担
		12,224	有担
			▲ 1,496

11/5の加重平均レート(速報)			11/4の加重平均レート(確報)		
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.060 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)		0.060 ~0.125 (0.085)	0.072 ~0.130 (0.079)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.121 (0.079)				0.077 (0.077)	
0.116 ~0.160 (0.117)				0.098 ~0.123 (0.117)	
0.118 (0.118)				0.310 (0.310)	
0.600 (0.600)		0.07-0.12			有担先日付分
		0.07-0.11			
		0.07-0.11	▲0.007-▲0.004		
		-			
		-			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	11/9 ~ 2/8 (91日間)	応札	1,683億円	落札	1,683億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	4,000億円	11/5 ~ 11/6 (1日間)	応札	6億円	落札	6億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
CP買入	3,500億円	11/10	応札	6,081億円	落札	3,496億円	按分レート	0.065%	3.7%	平均落札レート	0.071%
T-Bill3M	応札24兆1,328億円	落札4兆3,681億3,000万円(非競争入札:3,818億円)									11/9~2016/2/15 ▲0.0037% 按分40.5564% 平均▲0.0055%
10年利付国債(表面利率0.4%)	応札6兆1,112億円	落札2兆1,811億円(I非競争入札:2,151億円)									11/9~2025/9/20 0.320% 按分78.1838% 平均0.318%

「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

<< 11/6の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,485,900	前日比	21,200
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。					

<< 5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1兆7,000億円増加の184兆8,000億円(当座預金残高見込みは246兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態を中心に0.075~0.077%近辺、大手行からは0.075%での調達希望で始まった。立ち上がりは前日比横ばいの0.075~0.077%での出合いであった。一巡後は取り下がり0.07~0.075%近辺の出合いで本日の取引を終えた。ターム物はメガバンクより1Wの期間で調達が見られた。

<< 5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3M物の入札が実施され、平均落札利回▲0.0055%・按分落札利回▲0.0037%と、堅調な結果となった。入札後は新発・既発の3M近辺に買いが入り、強含む展開となった。CP市場はCP等買入オペが、前回比500億円減額の3,500億円でオファーされた。足元の発行量の伸び悩みと、応札可能銘柄の少なさで、応札額は6,081億円と低調。按分利回は前回横ばいの0.065%、平均落札利回は0.071%と小幅低下した。発行市場は、償還総額500億程度に対し、発行総額は400億円程度と案件に乏しく、レートは横ばい圏での動きとなった。

- << 6日の材料 >>**
- *黒田日銀総裁、内外情勢調査会にて講演
 - *9月の景気動向指数速報
 - *米国9月の消費者信用残高
 - *米国10月の雇用統計
 - *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、11/10発行)
 - *交付税特別会計借入(10,500億円、11/17借入)

<<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	0.310	0.000	日経平均株価(終値)	19,116.41	189.50	為替(9時)	121.52-54
						為替(5時)	121.80-81

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	10/28	10/29	10/30	11/2	11/4	11/5
日銀当預残	2,472,900	2,468,700	2,471,800	2,464,300	2,449,400	2,464,700
準備預金残	2,250,800	2,240,800	2,244,200	2,237,900	2,230,000	2,242,600
レート	0.076%	0.076%	0.074%	0.076%	0.085%	0.077%
月中平均	0.07618%	0.07617%	0.07603%	0.07533%	0.07775%	0.07760%