

**<<資金需給>>**

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,200	900	0
財政		▲ 29,300	▲ 17,000	▲ 1,000
資金過不足		▲ 28,100	▲ 16,100	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,700		
64,884		▲ 2,400		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				17,500
国庫短期証売却				
国債買入			4,800	11,800
CP等買入			3,500	
		▲ 200	▲ 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			100	
国債補完供給				
小計		▲ 900	7,900	29,300
当預増減		▲ 29,000	▲ 8,200	28,300

<< 11/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,447,300	前日比	▲ 8,200
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。					

<< 9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2兆5,000億円減少の183兆4,000億円(当座預金残高見込みは245兆7,000億円)。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。一部で試し取りの0.125%での出合いも見受けられたものの、その他の参加者の調達姿勢に変化は見られず、立ち上がりは0.075~0.077%近辺の出合いが中心。一巡後は0.07~0.075%のレンジで出合いが見られた。ターム物は、1W物の期間で大手行による幅広い調達が見られた。

<< 9日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国買入オペが前回比1兆円増額の17,500億円でオフアされた。引け値の低い特定の銘柄を中心に落札されたと見られ、平均利回較差+0.006%、按分利回較差+0.005%、按分率91%となった。オペ後は3M物で▲0.005%、6M物で▲0.15~▲0.14%、1Y物で▲0.05%の出合いが見られた。CP市場は、発行案件に乏しく発行総額は400億円程度と閑散だった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

- << 10日の材料 >>
- \*9月の国際収支
  - \*9月の特定サービス産業動態統計速報
  - \*10月の景気ウォッチャー調査
  - \*米国9月の卸売売上高
  - \*10年物価連動国債(5,000億円、11/12発行)

当座預金残高	2,455,500	11/9以降の残り所要積立額	1,700
準備預金残高	2,236,300	11/10以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,833,900	積数	1,000
超過準備	1,833,900	1日平均	200
非準備先残高	219,200	積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)	2,025,400
準備預金進捗率	99.95% (実績)		80.65% (日数)

JGB新発10年債	0.330	0.015	日経平均株価(終値)	19,642.74	377.14	為替(9時)	123.19-20
						為替(5時)	123.38-39

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	10/30	11/2	11/4	11/5	11/6	11/9
日銀当預残	2,471,800	2,464,300	2,449,400	2,464,700	2,484,500	2,455,500
準備預金残	2,244,200	2,237,900	2,230,000	2,242,600	2,256,500	2,236,300
レート	0.074%	0.076%	0.085%	0.077%	0.077%	0.078%
月中平均	0.07603%	0.07533%	0.07775%	0.07760%	0.07738%	0.07744%

11/9の加重平均レート(速報)				11/6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 (0.078)		0.030 ~ 0.040 (0.031)				0.060 ~ 0.125 (0.077)		0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.072 ~ 0.121 (0.082)						0.072 ~ 0.121 (0.078)		
0.098 ~ 0.155 (0.118)						0.077 ~ 0.160 (0.086)		
0.160 (0.160)						0.075 (0.075)		
				0.07-0.12	-			有担先日付分
				0.07-0.11	-			
				0.07-0.11	▲0.005			
				-	▲0.15-▲0.14			
				-	▲0.05			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	7,088億円	11/9	~ 11/10 (1日間) 応札	25億円	落札	25億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	17,500億円	11/11	応札	32,546億円	落札	17,502億円	0.005%	91.0%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	11/11	応札	9,894億円	落札	4,003億円	0.004%	78.3%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	11/11	応札	10,448億円	落札	4,008億円	0.007%	54.3%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	2,400億円	11/11	応札	6,793億円	落札	2,406億円	0.017%	96.1%	平均利回り較差	0.018%
国債買入	1,400億円	11/11	応札	5,204億円	落札	1,406億円	0.017%	24.2%	平均利回り較差	0.019%

「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り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