

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想	12日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,000	400	0
財政		▲ 16,800	400	▲ 3,000
資金過不足		▲ 15,800	800	▲ 3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
64,884				
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	12,200	
CP等買入		3,500		
		▲ 500	▲ 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		
国債補充供給				
小計		7,900	29,200	0
当増減		▲ 7,900	30,000	▲ 3,000

<< 11/11の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,477,600	前日比	30,000
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。

<< 10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182兆7,000億円(当座預金残高見込みは244兆7,000億円)。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。本日も一部で試し取りが行われ、0.125%近辺の出合いも見受けられた。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、閑散な地合いであった。

<< 10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。短国市場は3M物で▲0.005%、6M物で▲0.15~▲0.145%の出合いが見られた程度と閑散であった。CP市場はノンバンク業態から大型発行案件が見られ、発行総額は1,200億円程度となった。発行レートは一部で強めの決着も見られたが、概ね横ばい圏で推移した。

<< 11日の材料 >>
 *原田日銀審議員、栃木県金融経済懇談会にて講演
 *10月のマネーストック
 *米国休日(Veterans Day)

当座預金残高	2,447,600	11/10以降の残り所要積立額	1,000
準備預金残高	2,223,800	11/11以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,821,100	積数	300
超過準備	1,821,100	1日平均	100
非準預先残高	223,800		
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	99.99% (実績)	83.87% (日数)	

JGB新発10年債	0.310	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	19,671.26	28.52	為替(9時)	123.05-07
						為替(5時)	123.35-37

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	11/2	11/4	11/5	11/6	11/9	11/10
日銀当預残	2,464,300	2,449,400	2,464,700	2,484,500	2,455,500	2,447,600
準備預金残	2,237,900	2,230,000	2,242,600	2,256,500	2,236,800	2,223,800
レート	0.076%	0.085%	0.077%	0.077%	0.078%	0.077%
月中平均	0.07533%	0.07775%	0.07760%	0.07738%	0.07744%	0.07740%

11/9のマネタリーベース				3,424,500		
11/9コール	合計	226,311	無担	91,014	有担	135,297
コール前日増減	計	3,046	無担	1,411	有担	1,635

11/10の加重平均レート(速報)				11/9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	
0.060 ~0.130 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.125 (0.078)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.072 ~0.121 (0.080)				T/N		0.072 ~0.121 (0.082)		
				S/N				
0.118 (0.118)				1W	0.117 ~0.155 (0.132)	0.098 ~0.117 (0.116)		
0.165 (0.165)				2W	0.160 (0.160)			
				3W				
		0.07-0.12	-	1M				有担先日付分
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.005	3M				
		-	▲0.15-▲0.145	6M				
		-	-	1Y				

<<オベ情報、入札結果>>

社債買入 750億円 11/16 応札 1,798億円 落札 751億円 按分レート 0.081% 8.0% 平均落札レート 0.118%
 米ドル資金供給(固定金利方式) 11/13~11/19(6日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.620%
 10年物価連動国債(表面利率年0.1%) 応札 1兆1,064億円 落札 4,998億円 11/12~2025/3/10 ▲0.459% 按分96.8750%
 ETF買入 362億円 約定日 11/10
 J-REIT買入 14億円 約定日 11/10

「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