

<<資金需給>>

単位 億円

	11日需給速報		12日需給予想		13日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		400	▲ 200	▲ 1,000		
財政		300	▲ 3,500	3,000		
資金過不足		700	▲ 3,700	2,000		
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		12,200		12,000		
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						
小計		29,200	▲ 100	12,000		
当預増減		29,900	▲ 3,800	14,000		

<< 11/12の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,473,700	前日比	▲ 3,800
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。					

<< 11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2兆2,000億円増加の184兆9,000億円(当座預金残高見込みは247兆8,000億円)。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%の調達希望で始まった。立ち上がりは0.076~0.078%の出合いであった。引き続き試し取りの0.125%の出合いが散見された。一巡後も同水準の出合いで本日の取引を終えた。ターム物は閑散とした取引であった。

<< 11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▲0.006~▲0.005%の出合いと若干の強含みで推移し、6M物は▲0.148~▲0.14%の出合いと横ばいだった。CP市場は15日にかかる取引となったことで、ノンバンク業態から大型発行案件が見られ、発行総額は1,800億円程度と膨らんだ。発行レートは横ばい圏で推移した。

<< 12日の材料 >>
 *9月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+3.3%)
 *10月の企業物価指数
 *米国10月の財政収支
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、48,000億円、11/16発行)
 *30年利付国債入札(8,000億円、11/16発行)

当座預金残高	2,477,500	11/11以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,254,300		300
積み終了先	1,850,000	11/12以降の残り所要積立額	
超過準備	1,849,800	積数	100
非準備先残高	223,200	1日平均	0
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	100.00% (実績)		87.10% (日数)

JGB新発10年債	0.315	0.005	日経平均株価(終値)	19,691.39	20.13	為替(9時)	123.09-10
						為替(5時)	122.93-95

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	11/4	11/5	11/6	11/9	11/10	11/11
日銀当預残	2,449,400	2,464,700	2,484,500	2,455,500	2,447,600	2,477,500
準備預金残	2,230,000	2,242,600	2,256,500	2,236,800	2,224,200	2,254,300
レート	0.085%	0.077%	0.077%	0.078%	0.077%	0.078%
月中平均	0.07775%	0.07760%	0.07738%	0.07744%	0.07740%	0.07745%

11/10のマネタリーベース			3,415,600			
11/10コール	合計	225,282	無担	89,446	有担	135,836
コール前日増減	計	▲ 1,029	無担	▲ 1,568	有担	539

11/11の加重平均レート(速報)				11/10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	
0.060 ~0.125 (0.078)	0.030 ~0.040 (0.031)					O/N	0.060 ~0.130 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.125 (0.079)						T/N		0.072 ~0.121 (0.080)	
						S/N			
						1W		0.118 (0.118)	
0.310 (0.310)						2W		0.165 (0.165)	
						3W			
						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	11/11	~ 11/12 (1日間)	応札	33億円	落札	33億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	11/13	応札	10,363億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.002%	86.9%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	11/13	応札	17,914億円	落札	4,009億円	按分利回り較差	0.006%	22.8%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,000億円	11/13	応札	15,545億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	0.005%	72.8%	平均利回り較差	0.006%

「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