

<<資金需給>>

単位 億円

	12日需給速報		13日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	▲ 500	0
財政		▲ 2,300	5,900	▲ 19,000
資金過不足		▲ 2,600	5,400	▲ 19,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				1,100
64,884				▲ 1,200
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入			12,100	
CP等買入				
		▲ 100	▲ 900	
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				800
ETF買入			200	
国債補完供給				
小計		▲ 100	11,400	700
当預増減		▲ 2,700	16,800	▲ 18,300

<< 11/13の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,491,600	前日比	16,800
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。

<< 12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2,000億円増加の185兆1,000億円(当座預金残高見込みは247兆4,000億円)。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%の調達希望で始まり、立ち上がりは0.075~0.078%の出合い。一巡後は0.075%近辺の出合いと、引き続き試し取りの動きによる0.125%出合いが見られる中で本日の取引を終えた。ターム物は証券業態のロール案件が散見された程度であった。3M物の共通担保オペが8,000億円オファーされ、応札額は1,141億円(期落ち額1,240億円)となった。

<< 12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物の入札が実施された。W I取引で▲0.03%が出合うなど過熱感が強い中、平均落札利回▲0.0301%、按分落札利回▲0.0186%、按分率6.7151%と、按分利回が過去最低を記録する強い入札となった。セカンダリーは▲0.06~▲0.02%の出合いと売り買い交錯した。その他は6M物で▲0.149~▲0.105%で少額の出合いが見られた。CP市場は商社・建設業態からまとまった発行が見られ、発行総額は1,300億円程度となった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

<< 13日の材料 >>

- *9月のマネタリーサーバイ *9月の第3次産業活動指数
- *9月の石油等消費動態統計
- *米国9月の企業在庫 *米国10月の生産者物価指数 *米国10月の小売売上高
- *米国11月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- *ユーロ圏7-9月期のGDP速報値

当座預金残高	2,474,800	11/12以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,254,200		100
積み終了先	1,850,800	11/13以降の残り所要積立額	
超過準備	1,850,800	積数	0
非準預先残高	220,600	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)	90.32% (日数)	

JGB新発10年債	0.305	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	19,697.77	6.38	為替(9時)	122.75-77
						為替(5時)	122.93-94

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	11/5	11/6	11/9	11/10	11/11	11/12
日銀当預残	2,464,700	2,484,500	2,455,500	2,447,600	2,477,500	2,474,800
準備預金残	2,242,600	2,256,500	2,236,800	2,224,200	2,254,400	2,254,200
レート	0.077%	0.077%	0.078%	0.077%	0.078%	0.078%
月中平均	0.07760%	0.07738%	0.07744%	0.07740%	0.07745%	0.07750%

11/11のマネタリーベース				3,445,100
11/11コール	合計	225,462	無担	90,645
				有担
				134,817
コール前日増減	計	180	無担	1,199
				有担
				▲ 1,019

11/12の加重平均レート(速報)				11/11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 (0.078)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.121 (0.080)							0.073 ~0.125 (0.079)	
0.130 (0.130)								
0.160 (0.160)							0.310 (0.310)	
0.075 ~0.165 (0.137)				0.07-0.12	-			有担先日付分
				0.07-0.11	-			
				0.07-0.11	▲0.06-▲0.02			
				-	▲0.149-▲0.105			
				-	-			
				-	-			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 11/16 ~ 2/15 (91日間) 応札 1,141億円 落札 1,141億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 国債補完 4,000億円 11/12 ~ 11/13 (1日間) 0億円 0億円 0% 按分 平均 (即)

T-Bill3M 応札18兆9,695億円 落札4兆3,430億7,000万円(非競争入札:4,169億円) 11/16~2016/2/22 ▲0.0186% 按分6.7151% 平均▲0.0301%
 30年利付国債(表面利率1.4%) 応札2兆3,018億円 落札7,260億円(I非競争入札:730億円) 11/16~2045/9/20 1.388% 按分82.1830% 平均1.385%

「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