

<<資金需給>>

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想		24日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,900	▲ 2,000			0
財政		▲ 29,900	▲ 10,200	▲ 4,000		
資金過不足		▲ 31,800	▲ 12,200	▲ 4,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						2,800
64,785		0				▲ 2,700
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		3,500	▲ 600			
		▲ 200				
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			▲ 100			
ETF買入		300	100			
国債補完供給						
小計		3,600	11,500			100
当預増減		▲ 28,200	▲ 700			▲ 3,900

当座預金残高	2,462,700	11/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,235,800		133,800
積み終了先	1,809,600	11/20以降の残り所要積立額	
超過準備	1,796,500	積数	97,600
非準備先残高	226,900	1日平均	3,800
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)			1,964,600
準備預金進捗率	95.03% (実績)		13.33% (日数)

11/18のマナターベース		3,458,900	
11/18コール	合計	199,885	無担 64,721 有担 135,164
コール前日増減	計	▲ 3,239	無担 ▲ 2,982 有担 ▲ 257

11/19の加重平均レート(速報)				11/18の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.060 ~0.125 (0.078)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.125 (0.084)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.121 (0.082)						0.073 ~0.130 (0.079)	
0.117 ~0.118 (0.117)						0.130 (0.130)	
0.120 ~0.150 (0.131)						0.310 (0.310)	
						0.280 (0.280)	有担先日付分
		0.07~0.12	-				
		0.07~0.11	-				
		0.07~0.11	▲0.12-▲0.09				
		-	-				
		-	▲0.14-▲0.10				

<< 11/20の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,462,000	前日比	▲ 700
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%台後半での出合いが中心になると見込まれる。

<< 19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3兆1,000億円減の183兆7,000億円(当座預金残高見込みは246兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.075~0.078%での調達、大手行からは0.06%での調達希望が始まった。一巡後は、0.07~0.075%で散發的な出合いが見られる程度で本日の取引を終えた。また、一部邦銀から0.125%での試し取りが行われた。ターム物は、大手行から1W物0.117%でまとまった調達が見られた。

<< 19日のオープン市場動向 >>
 短国現先レートS/Nは短国の発行日要因から、前日に続いてやや上昇した。短国アウトライト市場は買いが強く、3M物が▲0.12~▲0.09%、1Y物が▲0.14~▲0.10%の出合いだった。CP市場はノンバンク等からのまとまった発行案件があり、償還総額1,300億円程度に対して、発行総額は1,700億円程度となった。発行レートは引き続き低位で推移した。

<< 20日の材料 >>
 *黒田日銀総裁、貨幣博物館リニューアルオープンに際しての挨拶
 *金融経済月報
 *流動性供給入札(5,000億円、11/25発行)

<<コール10月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07684%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07700%	有担 0.03100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.295	0.000	19,859.81	210.63	123.50-52	123.36-37

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	11/12	11/13	11/16	11/17	11/18	11/19
日銀当預残	2,474,800	2,489,100	2,469,400	2,493,000	2,490,900	2,462,700
準備預金残	2,254,400	2,268,100	2,248,400	2,267,500	2,266,900	2,235,800
レート	0.078%	0.078%	0.078%	0.078%	0.084%	0.078%
月中平均	0.07750%	0.07760%	0.07763%	0.07765%	0.07800%	0.07800%

<<オペ情報、入札結果>>
 全店共通 8,000億円 11/24 ~ 2/22 (90日間) 応札 2,771億円 落札 2,771億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)

<<日銀金融政策決定会合・結果>>
 ・マナターベースが、年間約80兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(賛成8反対1)
 ・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)
 ①長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。買入れの平均残存期間は7年~10年程度とする。
 ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約3兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 ③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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