

《資金需給》

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想		26日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 700	▲ 1,000		
財政		▲ 5,400	▲ 200	1,000		
資金過不足		▲ 6,000	▲ 900	0		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		2,800				
64,865		▲ 2,700				
国債買現		0				
CP買現		0				
国庫短期証買入			2,500			
国庫短期証売却						
国債買入				11,000		
CP等買入		▲ 400	▲ 1,000			
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		100	200			
国債補完供給						
小計		▲ 200	1,600	11,000		
当預増減		▲ 6,200	700	11,000		

11/25の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,452,400	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0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

《 24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、前営業日比1兆3,000億円減の182兆7,000億円(当座預金残高見込みは245兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.076~0.078%での調達、大手行からは0.07%台前半での調達希望が始まった。一巡後は、0.07~0.075%で散発的な出合いが見られるなか本日の取引を終えた。また、一部邦銀から0.125%で試し取りが行われた。ターム物は、ロール案件が数件見られた。

《 24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。短国市場は先週の短国買入オペ減額の影響等から様子見姿勢が強く、閑散とした地合いが続いていた。CP市場はノンバンク、石油等業態からまとまった発行があり、発行総額は800億円程度となった。発行レートは低位横ばい圏で推移した。

《 25日の材料 》

- *白井日銀審議委員、島根県金融経済懇談会にて講演
- *金融政策決定会合議事要旨(10月30日開催分)
- *月例経済報告
- *9月の景気動向指数改訂状況
- *10月の企業向けサービス価格指数
- *米国10月の個人所得・消費支出
- *米国10月の新築一戸建て販売件数
- *米国10月の耐久財新規受注
- *20年利付国債入札(12,000億円、11/27発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、12/3借入)

当座預金残高	2,451,700	11/24以降の残り所要積立額	46,600
準備預金残高	2,234,200	11/25以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,819,400	積数	38,000
超過準備	1,819,300	1日平均	1,800
非準備先残高	217,500	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	98.07% (実績)		30.00% (日数)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.315	0.005	19,924.89	45.08	122.95-96	
				為替(5時)	122.65-67

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	11/16	11/17	11/18	11/19	11/20	11/24
日銀当預残	2,469,400	2,493,000	2,490,900	2,462,700	2,457,900	2,451,700
準備預金残	2,248,400	2,267,500	2,266,900	2,235,800	2,239,700	2,234,200
レート	0.078%	0.078%	0.084%	0.078%	0.077%	0.078%
月中平均	0.07763%	0.07765%	0.07800%	0.07800%	0.07783%	0.07783%

11/20のマナターベース		3,429,900	
11/20コール合計	204,476	無担	66,070
有担	138,406		
コール前日増減	計	9,842	無担
有担	8,791	有担	1,051

11/24の加重平均レート(速報)				11/20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		
0.060 ~0.125 (0.078)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.065 ~0.080 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.073 ~0.121 (0.083)				T/N		0.073 ~0.121 (0.082)		
				S/N				
0.130 (0.130)				1W				
0.160 ~0.165 (0.163)				2W				
				3W				
		0.07-0.12	-	1M				有担先日付分
		0.07-0.11	-	2M				
0.350 (0.350)		0.07-0.11	-	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完	4,000億円	11/24	~ 11/25 (1日間)	0億円	0億円	按分	平均	(即)
国債買入	3,000億円	11/26	応札 10,939億円	落札 3,000億円	全取利回り較差	0.014%	平均利回り較差	0.014%
国債買入	4,000億円	11/26	応札 16,832億円	落札 4,005億円	按分利回り較差	0.008%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	4,000億円	11/26	応札 12,654億円	落札 4,007億円	按分利回り較差	0.003%	平均利回り較差	0.005%

米ドル資金供給(固定金利方式) 11/27~12/3 (6日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.610%

J-REIT買入 14億円 約定日 11/24

「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