

**<<資金需給>>**

単位 億円

	30日需給速報		31日需給予想		4日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,600	▲ 1,300	▲ 1,000		
財政		0	400	▲ 16,000		
資金過不足		▲ 1,600	▲ 900	▲ 15,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			4,700	1,600		
93,489			▲ 9,700	▲ 2,900		
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			10,600			
CP等買入			3,700			
		▲ 100	▲ 2,500			
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053						
被災地支援						
3,255						
社債等買入			▲ 200			
ETF買入		100	100			
国債補完供給						
小計		0	6,700	▲ 1,300		
当増減		▲ 1,600	5,800	▲ 16,300		

当座預金残高	1,672,600	10/30以降の残り所要積立額	32,300
準備預金残高	1,528,500	10/31以降の残り所要積立額	28,800
積み終了先	1,254,500	積数	1,800
超過準備	1,254,500	1日平均	1,800
非準備先残高	144,100		
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)	1,919,700		
準備預金進捗率	98.50% (実績)	48.39% (日数)	

10/29のマナタリーベース		2,589,800	
10/29コール 合計	182,154 無担	74,789 有担	107,365
コール前日増減 計	3,908 無担	1,632 有担	2,276

10/30の加重平均レート(速報)			10/29の加重平均レート(確報)		
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
0.045 ~ 0.075 (0.059)	0.030 ~ 0.040 (0.031)			0.045 ~ 0.075 (0.059)	0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.070 ~ 0.125 (0.108)					0.056 ~ 0.120 (0.070)
					0.055 (0.055)
					0.088 (0.088)
0.145 ~ 0.340 (0.210)					0.175 (0.175)
0.118 ~ 0.170 (0.123)		0.08-0.12	-		
		0.08-0.12	-		
		0.08-0.12	▲0.02~0.002	0.090 (0.090)	
		-	-	0.117 (0.117)	
		-	-		
		-	-		

<< 10/31の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,678,400	前日比	5,800
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは、0.06%近辺での出合いが中心になると見込まれる。

**<< 30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125兆3,000億円(当座預金残高見込みは167兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.056~0.057%、大手行から0.05~0.055%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.057%程度となった。一巡後は、0.056~0.057%近辺での出合い。午後の取引は調整程度で一日の取引を終えた。ターム物については、ロール案件中心の取引となった。本日の共通担保オペは、期間3M程度で8,000億円がオフアールされた。結果は応札総額1,550億円の札割れとなり、オペ期落ち分の2,850億円を下回った。

**<< 30日のオープン市場動向 >>**  
 現先S/N物は横ばい圏で推移。短国市場では3M物(490回)入札が実施された。WI取引では▲0.02~▲0.01%で取引が見られ、入札結果は平均落札利回り▲0.0041%、按分落札利回り▲0.0018%と初めて按分落札利回りがマイナスとなり、非常に強い入札結果となった。セカンダリーは、調整売りから±0%付近で大きく出合うなど小甘い展開。CP市場は石油業態からのまとまった発行がみられ、1,800億円程度(同償還総額400億円程度)に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。

- << 31日の材料 >>**
- \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(終了後、直ちに結果公表)
  - \*経済・物価情勢の展望 \*9月の完全失業率(市場予想: 3.6%)
  - \*9月の有効求人倍率(市場予想: 1.09倍)
  - \*9月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比▲4.3%)
  - \*9月全国・10月都都区部消費者物価指数(CPI)
  - 市場予想: 全 国(9月)前年同月比(除く生鮮): +3.0%
  - 東京都都区部(10月)前年同月比(除く生鮮): +2.5%
  - \*9月の住宅着工統計 \*ユーロ圏10月の消費者物価指数速報値
  - \*米国9月の個人所得・消費支出 \*米国10月のシカゴPM景況感指数

JGB新発10年債	0.470	0.005	日経平均株価(終値)	15,658.20	104.29	為替(9時)	108.83-85
						為替(5時)	109.17-19

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	10/23	10/24	10/27	10/28	10/29	10/30
日銀当預残	1,648,600	1,654,600	1,641,000	1,673,100	1,674,200	1,672,600
準備預金残	1,514,900	1,516,800	1,501,700	1,532,600	1,527,000	1,528,500
レート	0.060%	0.060%	0.059%	0.059%	0.059%	0.059%
月中平均	0.05922%	0.05931%	0.05930%	0.05929%	0.05928%	0.05927%

**<< オペ情報、入札結果 >>**  
 全店共通 8,000億円 11/4 ~ 2/2 (90日間) 応札 1,550億円 落札 1,550億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 T-Bill3M 応札47兆6,750億円 落札5兆3,142億1,000万円(非競争入札: 4,257億円) 11/4~2015/2/9 ▲0.0018% 按分 85.8336% 平均▲0.0041%

「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