

**<<資金需給>>**

単位 億円

	5日需給速報		6日需給予想	7日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,300	0	▲ 1,000
財政		4,800	800	▲ 25,000
資金過不足		6,100	800	▲ 26,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		4,900		12,700
81,930		▲ 10,100		▲ 10,100
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			22,500	
国庫短期証売却				
国債買入			15,200	
CP等買入				
		▲ 200		
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				
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 5,400	37,700	2,600
当預増減		700	38,500	▲ 23,400

当座預金残高	1,656,700	11/5以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,516,200		17,600
積み終了先	1,250,100	11/6以降の残り所要積立額	
超過準備	1,249,600	積数	15,300
非準預先残高	140,500	1日平均	1,500
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			1,921,100
準備預金進捗率	99.20%	(実績)	67.74% (日数)

11/4のマネタリーベース		2,573,700	
11/4コール	合計	169,490	無担 62,141 有担 107,349
コール前日増減	計	▲ 6,453	無担 ▲ 8,980 有担 2,527

11/5の加重平均レート(速報)				11/4の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.030 ~0.135 (0.061)	0.030	~0.040 (0.031)		0.045 ~0.135 (0.061)		0.057 ~0.120 (0.080)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.120 (0.100)								
0.083 ~0.120 (0.105)						0.117 (0.117)		
0.118 (0.118)				0.160 (0.160)	0.117 ~0.330 (0.136)			
					0.117 ~0.118 (0.117)			
0.118 (0.118)		0.08~0.12	-	1M	0.090 ~0.120 (0.111)		有担先日付分	
		0.08~0.12	-	2M				
		0.08~0.12	-	3M				
		-	0.005~0.0172	6M				
		-	-	1Y				

<< 11/6の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,695,200	前日比	38,500
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.055~0.06%前後での出合いが中心になると見込まれる。

**<< 5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8,000億円増加の125兆7,000億円(当座預金残高見込みは165兆5,000億円)。無担O/Nは、地銀・信託業態から0.057~0.058%、大手行から0.055%での調達希望で立ち上がり、出合いの中心レートは0.057~0.058%近辺となった。一巡後は0.056~0.057%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。3M物の共通担保オペが1兆5,000億円オフアールされ、結果は落札総額1兆2,710億円となり、期落ち分の10,060億円を上回った。

**<< 5日のオープン市場動向 >>**  
 短国現先レートS/Nは前日から横ばい圏での推移となった。短国アウトライト市場は6Mで0.005~0.0172%の出合いが見られた。短国6M物の入札は、按分落札利回0.0177%、平均落札利回0.0118%、按分比率26.1585%という結果だった。CP市場は償還総額900億円程度に対し、発行総額1,000億円程度。発行レートは横ばい圏での推移であった。

- << 6日の材料 >>**
- \*日銀金融政策決定会合議事要旨(10月6、7日開催分)
  - \*9月の景気動向指数速報
  - \*ECB定例理事会(金融政策発表あり)
  - \*MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
  - \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、11/10発行)

<<コール10月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.05929%	有担 0.03035%
(営業日のみ)	無担	0.05900%	有担 0.03055%

JGB新発10年債	0.465	0.025	日経平均株価(終値)	16,937.32	74.85	為替(9時)	113.51-52
						為替(5時)	114.41-42

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	10/28	10/29	10/30	10/31	11/4	11/5
日銀当預残	1,673,100	1,674,200	1,672,600	1,677,000	1,656,000	1,656,700
準備預金残	1,532,600	1,527,000	1,528,500	1,540,700	1,518,700	1,516,200
レート	0.059%	0.059%	0.059%	0.060%	0.061%	0.061%
月中平均	0.05929%	0.05928%	0.05927%	0.05929%	0.06025%	0.06040%

**<<オペ情報、入札結果>>**  
 全店共通 15,000億円 11/7 ~ 2/17 (102日間) 応札 12,710億円 落札 12,710億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 T-Bill6M 応札20兆6,700億円 落札3兆2,396億5,000万円(非競争入札:2,603億円) 11/10~2015/5/14 0.0177% 按分26.1585% 平均0.0118%  
 10年利付国債(表面利率0.5%) 応札7兆7,415億円 落札2兆2,120億円(I非競争入札:1,838億円) 11/7~2024/9/20 0.441% 按分16.0866% 平均0.439%  
 交付税特会 1兆500億円 11/13~2015/5/13 応札 3兆3,455億円 落札 1兆500億円 0.092% 按分 90.0000% 平均 0.089%  
 ETF買入 380億円 約定日 11/5  
 J-REIT買入 12億円 約定日 11/5

「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