

《資金需給》

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想		12日当社予想	
	即日	金額		金額		金額
銀行券		1,100		800		1,000
財政		▲ 33,900		▲ 3,500		▲ 2,000
資金過不足		▲ 32,800		▲ 2,700		▲ 1,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		2,400		12,800		
82,900		▲ 4,000		▲ 12,900		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入				27,500		
国庫短期証売却						
国債買入		15,100				15,000
CP等買入						4,000
		▲ 300		▲ 100		
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	即日	▲ 200		200		
		100				
小計		13,100		27,500		19,000
当預増減		▲ 19,700		24,800		18,000

当座預金残高	1,655,700	11/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,514,700		4,800
積み終了先	1,251,400	11/11以降の残り所要積立額	
超過準備	1,251,400	積数	2,800
非準備先残高	141,000	1日平均	600
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			1,929,200
準備預金進捗率	99.85% (実績)		83.87% (日数)

11/7のマナターベース		2,591,300	
11/7コール合計	179,143	無担	67,507
		有担	111,636
コール前日増減	計 ▲ 1,679	無担	▲ 4,220
		有担	2,541

11/11の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,680,500	前日比	24.800
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12
無担O/Nは0.055~0.06%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

10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2兆円減少の125兆2,000億円(当座預金残高見込みは165兆6,000億円)。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0.058%近辺となった。一巡後は0.055~0.057%を中心とした出合いで推移し、一部業態からストレスチェックと思われる調達も行われつつ、本日の取引を終了した。ターム物は、引き続きロール案件による出合いが散見された。

10日のオープン市場動向
 現先レートは前日比で低下した。短国市場は品薄感が強く、全般的に閑散な中、3M▲0.007~▲0.005%、6M▲0.005%で共に少額の出合いが見られた程度であった。CP市場は入札件数・発行額共に少なく、発行総額は360億円程度にとどまるなど閑散であった。

11日の材料
 *9月の国際収支 *9月の特定サービス産業動態統計速報
 *10月の消費動向調査 *10月の景気ウォッチャー調査
 *New York祝日(Veteran's Day)
 *30年利付国債入札(6,000億円、11/13発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、11/19借入)

JGB新発10年債	0.455	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	16,780.53	▲ 99.85	為替(9時)	114.52-54
						為替(5時)	114.01-02

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	10/31	11/4	11/5	11/6	11/7	11/10
日銀当預残	1,677,000	1,656,000	1,656,700	1,695,100	1,675,400	1,655,700
準備預金残	1,540,700	1,518,700	1,518,900	1,549,300	1,541,800	1,514,700
レート	0.060%	0.061%	0.061%	0.061%	0.062%	0.068%
月中平均	0.05929%	0.06025%	0.06040%	0.06050%	0.06100%	0.06170%

11/10の加重平均レート(速報)				11/7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	有担先日付分	
0.030 ~0.135 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.135 (0.062)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.060 ~0.120 (0.069)					0.056 ~0.120 (0.076)			
				S/N				
0.125 ~0.400 (0.187)				1W	0.088 (0.088)			
0.143 ~0.160 (0.157)				2W	0.310 (0.310)			
				3W				
		0.08-0.12	-	1M	0.071 (0.071)		有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
0.265 (0.265)		0.08-0.12	▲0.007-▲0.005	3M				
		-	▲0.005	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債補完	2,000億円	11/10 ~ 11/11 (1日間)	応札	171億円	落札	171億円	-0.400%	全取	平均	-0.400%	
国債買入	5,500億円	11/12	応札	12,948億円	落札	5,502億円	按分利回り較差	0.002%	84.2%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	5,500億円	11/12	応札	16,422億円	落札	5,509億円	按分利回り較差	-0.007%	76.5%	平均利回り較差	-0.006%
国債買入	4,000億円	11/12	応札	11,336億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	-0.017%	64.5%	平均利回り較差	-0.015%
ETF買入	380億円	約定日	11/10								

「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り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