

<<資金需給>>

単位 億円

	21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
銀行券		▲ 2,700	▲ 100	▲ 1,000
財政		6,000	▲ 2,700	0
資金過不足		3,300	▲ 2,800	▲ 1,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)			2,700	
81,359			▲ 4,000	
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証買入				25,000
国庫短期証売却				
国債買入			12,200	8,000
CP等買入				
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053		▲ 400	▲ 1,000	
被災地支援		3,255		
社債等買入		▲ 100		
ETF買入		400	200	
国債補完供給				
小計		▲ 100	10,100	33,000
当預増減		3,200	7,300	32,000

当座預金残高	1,651,500	11/21以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,507,200		141,700
積み終了先	1,256,400	11/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,242,300	積数	58,400
非準預先残高	144,300	1日平均	2,800
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額(積数)			1,872,400
準備預金進捗率	96.88% (実績)	30.00% (日数)	

11/20のマナタリーベース		2,564,100	
11/20コール合計	191,782	無担	77,361
コール前日増減	計	▲ 3,848	▲ 940
		無担	▲ 2,908
		有担	▲ 940

11/21の加重平均レート(速報)				11/20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	有担当日分	有担先日付分
0.055 ~0.135 (0.069)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.135 (0.066)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.121 (0.080)				T/N	0.063 ~0.125 (0.082)		
				S/N			
0.124 ~0.400 (0.210)				1W	0.057 ~0.117 (0.098)		
				2W	0.118 ~0.310 (0.163)		
				3W			
0.118 ~0.145 (0.127)		0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.015~▲0.030	3M			
		-	-	6M			
		-	▲0.055	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	25,000億円	11/26	応札	34,860億円	落札	25,001億円	按分利回り較差	-0.030%	88.0%	平均利回り較差	-0.008%
国債買入	4,000億円	11/26	応札	13,413億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	-0.011%	1.5%	平均利回り較差	-0.009%
国債買入	2,400億円	11/26	応札	4,383億円	落札	2,406億円	按分利回り較差	-0.009%	13.2%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	1,600億円	11/26	応札	4,900億円	落札	1,604億円	按分利回り較差	-0.004%	17.0%	平均利回り較差	0.003%

被災地支援(第43回) 11/28~2015/11/27 (364日間) 貸付予定総額 0億円 貸付利率0.10 %

ETF買入 380億円 約定日 11/21

<< 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	1,658,800	前日比	7,300
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.055~0.065%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 21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6,000億円増加の126兆1,000億円(当座預金残高見込みは165兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.065%、地銀・信託業態から0.065~0.067%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.065~0.067%を中心とした出合い。都銀の0.065%のビッドによって全体のビッド水準が一段上昇し、一日を通して0.065%を下限とする水準で出合いなど、前日に比べて強い地合いとなった。ターム物は動意に乏しい展開であった。

<< 21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、短国買入オペが25,000億円でオファーされ、按分利回り格差▲0.030%、平均利回り格差▲0.008%と市場実勢を概ね反映した結果となった。アウトライトの気配は、3M:▲0.015~▲0.030%、1Y:▲0.055%となっていた。CP市場は、大型の調達案件が少なく、発行総額は900億円強にとどまった。依然として買い意欲が堅調であることから、発行レートは前日比同水準での推移となった。

<< 24日の材料 >>

*特にありません

<< 25日の材料 >>

*金融政策決定会合議事要旨(10月31日開催分)

*黒田日銀総裁、名古屋での経済界代表者との懇談会にて講演

*中曽日銀副総裁、パリ・ユーロプラス ファイナンス・フォーラムにて講演

*10月の企業向けサービス価格指数 *月例経済報告

*米国7-9月期のGDP改定値 *米国9月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数

*米国11月のCB消費者信頼感指数

JGB新発10年債	0.455	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,357.51	56.65	為替(9時)	118.24-26
						為替(5時)	117.56-58

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	11/14	11/17	11/18	11/19	11/20	11/21
日銀当預残	1,703,500	1,641,300	1,670,200	1,671,700	1,648,300	1,651,500
準備預金残	1,555,800	1,506,800	1,536,400	1,532,300	1,497,900	1,507,200
レート	0.066%	0.064%	0.065%	0.065%	0.066%	0.069%
月中平均	0.06319%	0.06324%	0.06333%	0.06342%	0.06355%	0.06446%

「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