

《資金需給》

単位 億円

	25日需給速報		26日需給予想		27日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	▲ 800	▲ 2,000		
財政		▲ 4,300	▲ 400	▲ 1,000		
資金過不足		▲ 4,600	▲ 1,200	▲ 3,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		2,700				
79,977		▲ 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	8,600	11,200		
CP等買入		▲ 1,000	▲ 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		200				
国債補完供給						
小計		10,100	33,400	11,200		
当預増減		5,500	32,200	8,200		

当座預金残高	1,657,000	11/25以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,513,600		58,400
積み終了先	1,264,000	11/26以降の残り所要積立額	
超過準備	1,261,600	積数	49,900
非準備先残高	143,400	1日平均	2,500
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	97.33%	(実績)	33.33% (日数)

11/21のマナリーベース		2,570,200	
11/21コール	合計	195,188	無担 79,778 有担 115,410
コール前日増減	計	3,406	無担 2,417 有担 989

11/25 の加重平均レート(速報)				11/21 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	
0.050 ~0.135 (0.065)	0.030	~0.040 (0.031)		O/N	0.055 ~0.135 (0.069)			0.030	~0.040 (0.031)
0.064 ~0.120 (0.076)				T/N		0.065 ~0.121 (0.080)			
				S/N					
0.090 ~0.117 (0.095)				1W		0.124 ~0.400 (0.210)			
0.160 ~0.245 (0.210)				2W					
0.140 (0.140)				3W					
0.160 (0.160)				1M		0.118 ~0.145 (0.127)			有担先日付分
				2M					
				3M					
				6M					
				1Y					

《オペ情報、入札結果》

国債補完	1,992億円	11/25	~ 11/26 (1日間)	応札	23億円	落札	23億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	5,500億円	11/27		応札	13,406億円	落札	5,504億円	按分利回り較差	0.005%	86.9%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	5,500億円	11/27		応札	13,390億円	落札	5,508億円	按分利回り較差	0.001%	28.8%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	200億円	11/27		応札	718億円	落札	201億円	按分価格較差	-0.15円	67.8%	平均価格較差	-0.279円
CP買入	4,000億円	11/28		応札	8,439億円	落札	4,000億円	按分レート	0.071%	15.0%	平均落札レート	0.082%
米ドル資金供給(固定金利方式)		11/28~12/4 (6日間)		応札	100万ドル	落札	100万ドル	貸付利率	0.600%			

「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

《 11/26の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,689,200	前日比	32,200
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%前後での出会いが中心になると見込まれる。					

《 25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126兆9,000億円(当座預金残高見込みは165兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06%、地銀・信託業態から0.06~0.063%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.06~0.065%を中心とした出会い。週末要因の剥落で全体の調達水準は一段下がったものの、0.06%のビッドは底堅く、一日を通して0.06~0.065%の出会いで推移した。ターム物はロール案件の取引が中心となった。

《 25日のオープン市場動向 》
現先レートS/Nは月末のファンディングニーズから小幅上昇した。短国アウトライト市場は品薄感が極端に強く、出会いも見られず閑散であった。C/P市場は月末前の発行日にあたったことで発行総額4,000億円程度に膨らんだ。C/P等買入オペは前回と比較して平均レートは0.082%と低下したものの、按分レートは0.071%と上昇した。

《 26日の材料 》
*白井日銀審議委員、広島県金融経済懇談会にて講演
*米国10月の新築一戸建て販売件数 *米国10月の個人所得・消費支出
*米国10月の耐久財新規受注
*英国7-9月期のGDP改定値
*40年利付国債入札(4,000億円、11/28発行)
*交付税特別会計借入(10,500億円、12/4借入)

JGB新発10年債	0.450	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	17,407.62	50.11	為替(9時)	118.43-45
						為替(5時)	117.94-95

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	11/17	11/18	11/19	11/20	11/21	11/25
日銀当預残	1,641,300	1,670,200	1,671,700	1,648,300	1,651,500	1,657,000
準備預金残	1,506,800	1,536,400	1,532,300	1,497,900	1,508,000	1,513,600
レート	0.064%	0.065%	0.065%	0.066%	0.069%	0.065%
月中平均	0.06324%	0.06333%	0.06342%	0.06355%	0.06446%	0.06448%