

<<資金需給>>

単位 億円

	6日需給速報		9日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		400	1,200	1,000
財政		7,600	▲ 28,100	▲ 19,000
資金過不足		8,000	▲ 26,900	▲ 18,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,700	
65,582			▲ 2,400	
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		12,100		4,700
CP等買入				3,500
		▲ 300	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 51,505 (増加) 252,028				
被災地支援				
3,161				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給				
小計		11,800	▲ 900	8,200
当預増減		19,800	▲ 27,800	▲ 9,800

当座預金残高	2,484,500	11/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,256,300		3,500
積み終了先	1,852,300	11/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,852,300	積数	1,700
非準預先残高	228,200	1日平均	200
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額(積数)			2,025,400
準備預金進捗率	99.92% (実績)		77.42% (日数)

11/5のマネタリーベース				3,435,300
11/5コール	合計	217,429	無担	85,059
			有担	132,370
コール前日増減	計	3,287	無担	5,438
			有担	▲ 2,151

11/6の加重平均レート(速報)				11/5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		有担当日分
0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)				O/N	0.060 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.121 (0.078)						T/N		
						S/N	0.072 ~0.121 (0.079)	
0.077 ~0.160 (0.086)						1W	0.050 ~0.160 (0.115)	
0.075 (0.075)						2W	0.118 (0.118)	
						3W		
				0.07-0.12	-	1M		0.600 (0.600)
				0.07-0.11	-	2M		
				0.07-0.11	▲0.004-▲0.003	3M		
				-	▲0.15-0.000	6M		
				-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	700億円	11/10	応札	2,140億円	落札	701億円	按分利回り較差	0.011%	62.5%	平均利回り較差	0.012%
国債買入	4,000億円	11/10	応札	11,118億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	-0.004%	57.6%	平均利回り較差	-0.003%
T-Bill6M	応札13兆5,579億円	落札3兆1,935億7,000万円(非競争入札:3,064億円)	11/10~2016/5/13	▲0.0315%	按分47.6753%	平均▲0.0394%					
交付税特会	1兆500億円	11/17~2016/5/17	応札2兆8,850億円	落札1兆500億100万円	0.068%	按分52.2225%	平均0.067%				
J-REIT買入	14億円	約定日	11/6								

「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

<< 11/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,456,700	前日比	▲ 27,800
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.07~0.08%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 6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1兆1,000億円増加の185兆9,000億円(当座預金残高見込みは248兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行から0.075%近辺、地銀・信託業態から0.075~0.077%近辺の調達希望で始まった。週末であったものの、昨日までと地合いに変化は見られず、立ち上がりは0.075~0.077%近辺の出合いが中心。一巡後は0.07~0.075%のレンジで出合いが見られた。ターム物は、閑散な地合いであった。

<< 6日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは、同水準で推移した。短国市場は6M物の入札が実施された。平均落札利回▲0.0394%、按分落札利回▲0.0315%と短国買入オペを睨んだ強めの結果となった。セカンダリーは、一時▲0.15%で出合うなど、加熱感のある相場となった。CP市場は、五・十日発行となるも、発行総額は1,400億円程度と、償還総額2,300億程度を下回り、落ち着いた地合いが続いた。発行レートは、一部銘柄で強めの決着が見られたものの、概ね横ばい圏で推移した。

<< 9日の材料 >>

- *9月の毎月勤労統計調査速報
- *10月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *米国10月のFRB労働市場情勢指数

<<コール10月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07603%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07610%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.315	0.005	日経平均株価(終値)	19,265.60	149.19	為替(9時)	121.69-70
						為替(5時)	121.87-89

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	10/29	10/30	11/2	11/4	11/5	11/6
日銀当預残	2,468,700	2,471,800	2,464,300	2,449,400	2,464,700	2,484,500
準備預金残	2,240,800	2,244,200	2,237,900	2,230,000	2,242,600	2,256,300
レート	0.076%	0.074%	0.076%	0.085%	0.077%	0.077%
月中平均	0.07617%	0.07603%	0.07533%	0.07775%	0.07760%	0.07738%