

2014/1/27(月)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	27日需給速報		28日需給予想	29日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		900	800	▲1,000
財政		▲17,300	6,900	2,000
資金過不足		▲16,400	7,700	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,100		
173,722		▲1,400		
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			7,300	4,200
CP等買入				
		▲800	▲300	
貸出支援基金 (成長) 34,599 (増加) 50,859				
被災地支援				
3,805				
社債等買入		▲500	▲400	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲600	31,600	4,200
当預増減		▲17,000	39,300	5,200

当座預金残高	1,058,300	1/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	962,200		111,800
積み終了先	815,900	1/28以降の残り所要積立額	
超過準備	814,900	積数	97,000
非準備先残高	96,100	1日平均	5,100
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			1,881,100
準備預金進捗率	94.84% (実績)		38.71% (日数)

1/24のマネタリーベース		1,980,400	
1/24コール	合計	178,837	無担 67,049 有担 111,788
コール前日増減	計	▲1,377	無担 1,119 有担 ▲2,496

1/27の加重平均レート(速報)				1/24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
0.060 ~0.145 (0.072)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N	0.055 ~0.145 (0.072)			0.040 ~0.050 (0.041)
0.070 ~0.120 (0.082)				T/N		0.072 ~0.120 (0.082)		
				S/N				
0.116 ~0.170 (0.131)				1W	0.130 (0.130)	0.117 ~0.400 (0.287)		
0.115 ~0.118 (0.116)				2W		0.170 ~0.330 (0.216)		
				3W				
0.118 ~0.153 (0.124)		0.08-0.13	0.0550	1M		0.116 ~0.180 (0.120)		有担先日付分
		0.08-0.13	0.0550	2M		0.375 (0.375)		
		0.08-0.13	0.0525	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債買入	4,000億円	1/29	応札	13,408億円	落札	4,010億円	按分利回り較差	-0.020%	77.6%	平均利回り較差	-0.019%
国債買入	200億円	1/29	応札	422億円	落札	200億円	按分価格較差	0.31円	95.0%	平均価格較差	0.171円
ETF買入	128億円	約定日	1/27								
J-REIT買入	3億円	約定日	1/27								

「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。」

《 1/28の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,097,600	前日比	39,300
O/N	0.06~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07%前後の出合いが中心となるであろう。

《 27日のインターバンク市場動向 》
 午前8時発表の準備預金先残高見込は83兆3,000億円。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07%台前半、大手行からは0.06%台前半での調達希望。出合いの中心は0.07%となった。一巡後も調達レートは変わらず、0.07%近辺での散発的な出合いが見られた。後場に入ると、ビッドが薄くなり、出合い閑散で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物0.117%、2W・1M物0.118%で調達を行った。

《 27日のオープン市場動向 》
 現先S/N物は先週末比小幅低下。短国市場は、方向感に乏しい中、店頭購入ニーズから少額の出合いがみられた程度。CP市場は、償還総額300億円程度に対し、情報・通信業態より500億円程度の大型発行案件などが見られたことから、発行総額は1,200億円強に膨らんだ。発行レートは、ファンディングレートやCP等買入オペの按分レート上昇などの要因から、最上位格付銘柄は引続き上昇傾向となっていた。

- 《 28日の材料 》
- *12月の企業向けサービス価格指数
 - *米国FOMC(1日目)
 - *米国11月のS&SP/ケース・シラー住宅価格指数
 - *米国12月の耐久財新規受注
 - *米国1月のCB消費者信頼感指数
 - *英国10-12月期のGDP速報値
 - *流動性供給入札(3,000億円、1/30発行)
 - *交付税特別会計借入(10,500億円、2/5借入)

JGB新発10年債	0.630	0.000	日経平均株価(終値)	15,005.73	▲385.83	為替(9時)	102.10-11
						為替(5時)	102.68-69

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	1/20	1/21	1/22	1/23	1/24	1/27
日銀当預残	1,062,900	1,090,100	1,098,000	1,072,400	1,075,300	1,058,300
準備預金残	964,800	984,100	986,700	968,700	974,600	962,200
レート	0.072%	0.071%	0.071%	0.072%	0.072%	0.072%
月中平均	0.07115%	0.07114%	0.07114%	0.07117%	0.07127%	0.07130%

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(登命)第526号 日本証券業協会加入