

2014/10/24(金)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	24日需給速報		27日需給予想	28日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,600	500	0
財政		2,000	▲ 11,100	1,000
資金過不足		400	▲ 10,600	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			4,100	10,000
95,098			▲ 4,000	▲ 11,700
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				22,500
国庫短期証売却				
国債買入		6,500		10,500
CP等買入				
		▲ 500	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援		100		
3,255		▲ 500		
社債等買入		▲ 100	▲ 100	
ETF買入		100		
国債補完供給				
小計		5,600	▲ 200	31,300
当預増減		6,000	▲ 10,800	32,300

当座預金残高	1,654,600	10/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,516,800		73,700
積み終了先	1,238,700	10/27以降の残り所要積立額	
超過準備	1,234,600	積数	45,300
非準備先残高	137,800	1日平均	2,300
積み期間(10/16～11/15)の所要準備額(積数)	1,920,500		
準備預金進捗率	97.64%	(実績)	35.48% (日数)

10/23のマナタリーベース	2,562,000
10/23コール合計	181,080 無担 72,294 有担 108,786
コール前日増減	計 ▲ 2,947 無担 ▲ 2,570 有担 ▲ 377

10/24 の加重平均レート(速報)				10/23 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		
0.045 ～0.135 (0.060)	0.020 ～0.040 (0.026)			O/N	0.045 ～0.135 (0.060)		0.020 ～0.040 (0.026)		
0.059 ～0.125 (0.086)				T/N		0.050 ～0.125 (0.072)			
				S/N					
0.055 ～0.117 (0.109)				1W		0.110 ～0.120 (0.117)			
0.330 (0.330)				2W					
				3W					
0.077 ～0.600 (0.087)		0.08-0.12	-	1M		0.118 (0.118)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12	▲0.030-▲0.008	3M					
		-	▲0.050	6M					
		-	-	1Y					

《オペ情報、入札結果》

全店共通	15,000億円	10/28	～ 2/6 (101日間) 応札	10,031億円	落札	10,031億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国短買入	22,500億円	10/28	応札	33,727億円	落札	22,501億円	按分利回り較差	-0.008%	1.3%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	3,500億円	10/28	応札	12,168億円	落札	3,500億円	全取利回り較差	0.001%		平均利回り較差	0.002%
国債買入	3,000億円	10/28	応札	7,581億円	落札	3,003億円	按分利回り較差	-0.010%	5.8%	平均利回り較差	-0.008%
国債買入	4,000億円	10/28	応札	12,587億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.013%	73.3%	平均利回り較差	-0.012%

「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の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

《 10/27の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,643,800	前日比	▲ 10,800
O/N	0.05～0.07	T/N	0.05～0.12	S/N	0.05～0.12

無担O/Nは、0.06%近辺での出合いが中心になると見込まれる。

《 24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124兆7,000億円(当座預金残高見込みは165兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.056～0.058%、大手行から0.05～0.055%での調達希望で始まり、出合いの中心は、0.058%程度となった。一巡後は、0.056～0.057%近辺での出合い。午後の取引は調整程度で一日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物を0.117%で調達を行った。

《 24日のオープン市場動向 》

現先S/N物は発行要因から小幅上昇となった。短国市場は動意に乏しく閑散。短国買入オペが22,500億円で実施され、按分利回り較差▲0.008%・平均利回り較差▲0.002%の結果となった。前回よりテールが縮小し、確実に売却したいというニーズが反映された結果であった。後場は3Mで▲0.03%まで買い進まれる動きも見られた。CP市場は発行案件に乏しく閑散。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

《 27日の材料 》

*9月の企業向けサービス価格指数

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	108.15-18
0.465 ▲ 0.015	15,291.64 152.68	為替(5時)	108.23-25

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	10/17	10/20	10/21	10/22	10/23	10/24
日銀当預残	1,696,100	1,652,000	1,654,600	1,660,900	1,648,600	1,654,600
準備預金残	1,560,700	1,508,600	1,522,100	1,520,800	1,514,900	1,516,800
レート	0.059%	0.060%	0.060%	0.061%	0.060%	0.060%
月中平均	0.05900%	0.05905%	0.05910%	0.05918%	0.05922%	0.05931%