

2014/8/11(月)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	11日需給速報		12日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,000	300	0
財政		▲ 42,600	2,200	▲ 4,000
資金過不足		▲ 41,600	2,500	▲ 4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		4,000		
104,128		▲ 5,000		
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				9,000
CP等買入		▲ 300	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488				
被災地支援				
3,623				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入		200	100	
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		▲ 1,300	▲ 200	34,000
当預増減		▲ 42,900	2,300	30,000

当座預金残高	1,471,400	8/11以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,350,000		3,600
積み終了先	1,140,500	8/12以降の残り所要積立額	
超過準備	1,140,500	積数	2,600
非準備先残高	121,400	1日平均	700
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)		1,911,300	
準備預金進捗率	99.86%	(実績)	87.10% (日数)

8/8のマネタリーベース		2,423,800
8/8コール	合計	169,313
無担		74,455
有担		94,858
コール前日増減	計	4,353
無担		3,393
有担		960

8/11 の加重平均レート(速報)					8/8 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 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.135 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)				
0.063 ~0.120 (0.074)				T/N		0.065 ~0.125 (0.086)					
				S/N		0.125 (0.125)					
0.117 ~0.400 (0.140)				1W	0.117 (0.117)						
0.118 (0.118)				2W		0.130 (0.130)					
0.118 (0.118)				3W							
		0.08-0.12	-	1M		0.255 (0.255)	有担先日付分				
		0.08-0.12	-	2M							
0.250 (0.250)		0.08-0.12	0.013-0.016	3M		0.116 ~0.270 (0.130)					
		-	-	6M							
		-	-	1Y							

《オペ情報、入札結果》

国債補完	4,000億円	8/11	~	8/12 (1日間)	応札	119億円	落札	119億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
社債買入	1,000億円	8/15	応札	1,893億円	落札	1,001億円	按分レート	0.111%	61.2%	平均落札レート		0.119%
国短買入	25,000億円	8/13	応札	33,482億円	落札	25,001億円	按分利回り較差	-0.005%	61.5%	平均利回り較差		-0.001%
国債買入	3,000億円	8/13	応札	11,220億円	落札	3,002億円	按分利回り較差	0.002%	8.0%	平均利回り較差		0.003%
国債買入	2,000億円	8/13	応札	13,125億円	落札	2,002億円	按分利回り較差	0.006%	87.0%	平均利回り較差		0.006%
国債買入	4,000億円	8/13	応札	12,202億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	0.005%	82.4%	平均利回り較差		0.005%

「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