

2014/10/23(木)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	23日需給速報		24日需給予想	27日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,100	▲ 1,500	0
財政		▲ 13,700	2,300	▲ 10,000
資金過不足		▲ 15,800	800	▲ 10,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				4,100
95,098				▲ 4,000
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			6,500	
CP等買入		3,500		
		▲ 100	▲ 500	
貸出支援基金 (成長) 38,608 (増加) 159,053				
被災地支援			100	
3,689			▲ 500	
社債等買入			▲ 100	
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		3,500	5,600	100
当預増減		▲ 12,300	6,400	▲ 9,900

当座預金残高	1,648,600	10/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,514,900		95,300
積み終了先	1,231,400	10/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,223,700	積数	73,700
非準備預先残高	133,700	1日平均	3,200
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	96.16%	(実績)	25.81% (日数)

10/22のマネタリーベース	2,572,100
10/22コール 合計	184,027 無担 74,864 有担 109,163
コール前日増減 計	455 無担 390 有担 65

10/23 の加重平均レート(速報)				10/22 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	有担先日付分	
0.045 ～0.135 (0.060)	0.020 ～0.040 (0.026)			O/N	0.045 ～0.135 (0.061)		0.030 ～0.040 (0.031)	
0.050 ～0.125 (0.072)				T/N		0.056 ～0.120 (0.077)		
				S/N				
0.110 ～0.120 (0.117)				1W		0.116 ～0.140 (0.126)		
				2W				
				3W				
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M		0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.010-▲0.004	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

《オペ情報、入札結果》

全店共通 8,000億円 10/27 ～ 1/26 (91日間) 応札 4,071億円 落札 4,071億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札52兆1,052億円 落札5兆2,576億8,000万円(非競争入札:4,522億円) 10/27～2015/2/2 0.000% 按分4.2781% 平均▲0.0037%
 流動性供給 応札 1兆5,122億円 落札 3,995億円 10/27 募入最大利回較差 ▲0.010% 按分 96.9816% 募入平均利回較差 ▲0.010%

「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

《 10/24の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,655,000	前日比	6,400
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。

《 23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1兆7,000億円減少の123兆9,000億円(当座預金残高見込みは164兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.056～0.057%、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0.057%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%、2Wおよび1M物を0.118%で調達を行った。

《 23日のオープン市場動向 》

現先S/N物は低位横ばい圏での推移となった。短国市場は動意に乏しく閑散。3M物の入札が実施された。落札結果は平均落札利回▲0.0037%、按分利回0.0000%となった。3M物としては、最高落札利回りが2005年12月14日入札以来の0.000%となり、平均落札利回りが初めてマイナスでの決着となる等、過熱感の強い結果となった。セカンダリーは3Mで▲0.010～▲0.004%の出合いが見られた程度であった。C P市場は鉄鋼業態からのまとまった発行案件が見られ、発行総額は1,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での取引となった。

《 24日の材料 》

*米国9月の新築一戸建て販売件数
 *英国7-9月期のGDP速報値

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	107.14-15
0.480 0.000	15,138.96 ▲ 56.81	為替(5時)	107.25-26

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	10/16	10/17	10/20	10/21	10/22	10/23
日銀当預残	1,699,800	1,696,100	1,652,000	1,654,600	1,660,900	1,648,600
準備預金残	1,554,000	1,560,700	1,508,600	1,522,100	1,520,800	1,514,900
レート	0.058%	0.059%	0.060%	0.060%	0.061%	0.060%
月中平均	0.05900%	0.05900%	0.05905%	0.05910%	0.05918%	0.05922%