

<<資金需給>>

単位 億円

	8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		6,500	4,200	5,000
財政		▲ 18,900	▲ 40,500	5,000
資金過不足		▲ 12,400	▲ 36,300	10,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		3,300		
176,474		▲ 4,300		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				20,000
国庫短期証売却				
国債買入		7,000		9,000
CP等買入				
		▲ 300	▲ 300	
貸出支援基金(成長)				
34,599				
(増加)				
50,859				
被災地支援				
3,804				
社債等買入				
ETF買入		200	200	
国債補完供給	即日	▲ 200		
		200	200	
小計		5,900	100	29,000
当預増減		▲ 6,500	▲ 36,200	39,000

当座預金残高	1,101,600	1/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	990,600		15,100
積み終了先	850,900	1/9以降の残り所要積立額	
超過準備	850,600	積数	11,900
非準備先残高	111,000	1日平均	1,700
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			1,860,200
準備預金進捗率	99.36%	(実績)	77.42% (日数)

1/7のマネタリーベース		2,040,400	
1/7コール	合計	179,693	無担 63,859 有担 115,834
コール前日増減	計	2,611	無担 5,181 有担 ▲ 2,570

<< 1/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,065,400	前日比	▲ 36,200
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。

<< 8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は、前営業日比3,000億円増の85兆9,000億円(当座預金残高見込は110兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07%程度での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。税揚げ日であったことから、昨日までに比べやや強めの展開となったものの、一巡後は0.06~0.065%での出合いも散見された。ターム物は、大手行から1M及び2W物で0.118%、1W物で0.117%のまとまった調達が見られた。

<< 8日のオープン市場動向 >>
 現先レートは発行要因から上昇。短国市場は短国買入オペが20,000億円実施され、平均利回較差▲0.001%、按分利回較差▲0.002%と概ね市場実勢水準での結果となった。オペ後は明日の入札を控えて、調整売りからか3M0.06%が出合い、売り残りとなった。CP市場は10日発行となり電機・石油・鉄鋼業態でまとまった発行が見られ、発行総額は2,100億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移。

- << 9日の材料 >>**
 *MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
 *ECB(欧州中銀)定例理事会
 *国庫短期証券入札(3カ月、57,000億円、1/14発行)
 *10年物価連動国債(3,000億円、1/14発行)

<<コール12月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07313%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07370%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	0.705	0.010	日経平均株価(終値)	16,121.45	307.08	為替(9時)	104.71-72
						為替(5時)	105.05-07

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	12/26	12/27	12/30	1/6	1/7	1/8
日銀当預残	1,064,100	1,063,600	1,070,800	1,096,900	1,108,100	1,101,600
準備預金残	962,400	960,900	969,600	986,000	998,200	990,600
レート	0.072%	0.073%	0.068%	0.072%	0.071%	0.071%
月中平均	0.07354%	0.07348%	0.07313%	0.06867%	0.06900%	0.06925%

1/8の加重平均レート(速報)				1/7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		
0.060 ~0.085 (0.071)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N	0.060 ~0.085 (0.071)	0.040 ~0.050 (0.041)		
0.120 (0.120)				T/N		0.072 ~0.120 (0.083)		
				S/N				
0.117 ~0.142 (0.122)				1W				
0.118 ~0.180 (0.123)				2W		0.118 ~0.340 (0.120)		
				3W		0.118 (0.118)		
0.116 ~0.118 (0.118)		0.07-0.13	0.0700	1M		0.118 ~0.180 (0.122)	有担先日付分	
		0.07-0.13	-	2M				
		0.07-0.13	0.057-0.060	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	1/8	~ 1/9 (1日間)	応札 215億円	落札 215億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国短買入	20,000億円	1/10		応札 58,093億円	落札 20,006億円	-0.002%	78.3%	平均利回り較差 -0.001%
国債買入	2,500億円	1/10		応札 6,197億円	落札 2,504億円	0.002%	68.8%	平均利回り較差 0.002%
国債買入	2,500億円	1/10		応札 7,851億円	落札 2,504億円	0.002%	58.6%	平均利回り較差 0.003%
国債買入	4,000億円	1/10		応札 13,186億円	落札 4,003億円	0.003%	41.4%	平均利回り較差 0.004%
交付税特会	1兆500億円	1/17~7/17		応札 3兆3,037億円	落札 1兆500億円	0.102%	按分 68.000%	平均 0.101%
J-REIT買入	3億円	約定日	1/8					

「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