

《資金需給》

単位 億円

	14日需給速報		15日需給予想		16日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		3,500		3,700		3,000
財政		▲ 14,700		▲ 46,800		1,000
資金過不足		▲ 11,200		▲ 43,100		4,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		2,100				
175,034		▲ 3,600				
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				3,200		9,000
CP等買入						4,000
		▲ 400		▲ 900		
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				100		
国債補完供給						
小計		▲ 1,900		2,400		38,000
当預増減		▲ 13,100		▲ 40,700		42,000

当座預金残高	1,094,000	1/14以降の残り所要積立額	
準備預金残高	999,200		2,600
積み終了先	873,700	1/15以降の残り所要積立額	
超過準備	873,600	積数	1,000
非準備先残高	94,800	1日平均	1,000
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			1,871,800
準備預金進捗率	99.95% (実績)		96.77% (日数)

1/10のマネタリーベース		2,025,400	
1/10コール	合計	179,641	無担 65,568 有担 114,073
コール前日増減	計	▲ 624	無担 1,048 有担 ▲ 1,672

1/14の加重平均レート(速報)				1/10の加重平均レート(確報)			
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
0.060 ~0.145 (0.072)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.085 (0.074)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.072 ~0.120 (0.082)				T/N	0.072 ~0.120 (0.087)		
				S/N			
0.117 ~0.160 (0.132)				1W 0.130 (0.130)	0.153 (0.153)		
				2W			
				3W			
0.118 (0.118)		0.07-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.07-0.13	-	2M	0.118 (0.118)		
		0.07-0.13	0.0630	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

《オペ情報、入札結果》

国短買入	25,000億円	1/16	応札	71,499億円	落札	25,015億円	按分利回り較差	-0.002%	56.4%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	2,500億円	1/16	応札	6,566億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	0.001%	46.4%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	2,500億円	1/16	応札	9,796億円	落札	2,503億円	按分利回り較差	-0.007%	18.7%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	4,000億円	1/16	応札	10,924億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	-0.028%	11.4%	平均利回り較差	-0.025%

米ドル資金供給(固定金利方式) 1/16~1/24 (8日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.580%  
 預保借入(危機対応勘定) 702億円 1/22~2015/1/22 応札 3,236億円 落札 702億円 0.101% 按分 0.285% 平均 0.100%  
 ETF買入 128億円 約定日 1/14  
 J-REIT買入 3億円 約定日 1/14

「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。」

《 1/15の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,053,300	前日比	▲ 40,700
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。

《 14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8,000億円減の87兆5,000億円(当座預金残高見込は109兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07%台前半での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。積み最終日を明日に控え、調達ニーズは限定的。出合い巡後は軟調な展開となった。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が数件みられた。

《 14日のオープン市場動向 》  
 現先レートは、横ばい圏で推移した。短国市場は、短国買入オペが25,000億円と前日比5,000億円増額で実施されたものの、平均利回格差▲0.001%、按分利回較差▲0.002%、按分比率56.4%と市場実勢通りの結果となった。セカンダリー市場は、WIの1Yで0.050%売り/0.060%買い気配、6Mで0.055%売り/0.060%買い気配、3Mで0.063%の出合い等が見られた。CP市場は、償還総額800億円強に対して、発行総額は800億円。発行件数こそ少ないものの、複数の小売業態からまとまった額の発行が見られた。引き続き運用ニーズは堅調で、利回水準に目立った変化は見られなかった。

《 15日の材料 》  
 \*11月の特定サービス産業動態統計速報 \*12月のマネーストック  
 \*米国12月の生産者物価指数  
 \*国庫短期証券入札(1年、25,000億円、1/20発行)  
 \*30年利付国債入札(6,000億円、1/17発行)  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、1/23借入)

JGB新発10年債	0.650	▲ 0.045	日経平均株価(終値)	15,422.40	▲ 489.66	為替(9時)	103.10-12
						為替(5時)	103.45-46

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	1/6	1/7	1/8	1/9	1/10	1/14
日銀当預残	1,096,900	1,108,100	1,101,600	1,065,100	1,107,100	1,094,000
準備預金残	986,000	998,200	990,800	970,300	1,005,700	999,200
レート	0.072%	0.071%	0.071%	0.073%	0.074%	0.072%
月中平均	0.06867%	0.06900%	0.06925%	0.06967%	0.07100%	0.07107%

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