

《資金需給》

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想		17日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		3,800	2,100	2,000		
財政		▲ 46,900	3,300	▲ 4,000		
資金過不足		▲ 43,100	5,400	▲ 2,000		
貸出	即日	100	▲ 100			
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		175,034				
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	9,200			
CP等買入		▲ 900	▲ 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		100	100			
国債補完供給						
小計		2,500	37,900	0		
当増減		▲ 40,600	43,300	▲ 2,000		

《 1/16の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,096,700	前日比	43,300
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。

《 15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、前日比3兆5,000億円減の84兆円(当座預金残高見込は105兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07%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。積み最終日となるなか、源泉税揚げや国債の発行が重なった事で、朝方は一定の調達ニーズがあったものの、出合い一巡後は軟調な展開となり本日の取引を終えた。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。

《 15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、1Y物の入札が実施された。W I取引では0.055%で少額の出合い。入札結果は平均落札利回0.057%、按分落札利回0.058%、按分比率96.6356%と前回比利回でやや低下した。セカンダリー市場では0.057%での出合いが見られた。その他期間では、3M0.0625~0.063%の出合いが見られた程度で閑散。CP市場は、償還額2,400億円強に対し、電機・石油業態よりまとまった案件が見られたことから、発行額は2,500億円強と上回った。引き続き投資家の購入意欲は強く、利回水準は概ね横ばい圏で推移した。

《 16日の材料 》
 *11月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+1.2%)
 *11月の第3次産業活動指数 *12月の企業物価指数
 *日銀支店長会議 さくらレポート(=地域経済報告)
 *米国12月の消費者物価指数 *ユーロ圏12月の消費者物価指数改定値
 *国庫短期証券入札(3カ月、57,000億円、1/20発行)

《コール12月積み期間分の加重平均レート》

(土日を含む)	無担	0.07187%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07235%	有担	0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	104.19-20
0.660 0.010	15,808.73 386.33	為替(5時)	104.29-30

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	1/7	1/8	1/9	1/10	1/14	1/15
日銀当預残	1,108,100	1,101,600	1,065,100	1,107,100	1,094,000	1,053,400
準備預金残	998,200	990,800	970,300	1,005,700	999,300	968,700
レート	0.071%	0.071%	0.073%	0.074%	0.072%	0.072%
月中平均	0.06900%	0.06925%	0.06967%	0.07100%	0.07107%	0.07113%

当座預金残高	1,053,400	1/15以降の残り所要積立額	
準備預金残高	968,700		1,000
積み終了先	839,500	1/16以降の残り所要積立額	
超過準備	838,500	積数	1,881,100
非準備先残高	84,700	1日平均	60,700
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			1,871,800

1月の新所要見込 **1,881,100** (一日平均)

1/14のマナタリベース		2,008,800	
1/14コール	合計	178,020	無担 65,246 有担 112,774
コール前日増減	計	▲ 1,621	無担 ▲ 322 有担 ▲ 1,299

1/15の加重平均レート(速報)				1/14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		有担当日分	
0.060 ~0.145 (0.072)	0.040 ~0.050 (0.041)					O/N	0.060 ~0.145 (0.072)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.070 ~0.120 (0.079)				T/N		0.072 ~0.120 (0.082)			
				S/N					
				1W		0.117 ~0.160 (0.132)			
				2W					
				3W					
0.100 ~0.118 (0.112)		0.07-0.13	-	1M		0.118 (0.118)		有担先日付分	
		0.07-0.13	0.0610	2M					
		0.07-0.13	0.0625-0.0630	3M					
		-	0.0600	6M					
		-	0.055-0.057	1Y					

《オペ情報、入札結果》

T-Bill 1Y 応札13兆2,192億円 落札2兆3,002億5,000万円(非競争入札:1,997億円) 1/20~2015/1/20 0.0580%按分96.6356%平均0.0570%
 30年利付国債(表面利率1.7%) 応札1兆8,329億円 落札5,482億円(I非競争入札:507億円) 1/17~2043/12/20 1.672% 按分39.9026% 平均1.665%
 交付税特会 1兆500億円 1/23~7/24 応札 3兆3,957億円 落札 1兆500億円 0.102% 按分 52.4477% 平均 0.101%

「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録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