

《資金需給》

単位 億円

	16日需給速報		17日需給予想		20日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		2,200	1,200		1,000	
財政		2,600	▲ 300		▲ 33,000	
資金過不足		4,800	900		▲ 32,000	
貸出	即日	▲ 100				
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
175,034					▲ 4,700	
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		9,200			7,000	
CP等買入		4,000				
		▲ 300			▲ 800	
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			200	
国債補完供給						
小計		37,900			▲ 600	2,300
当預増減		42,700			300	▲ 29,700

当座預金残高	1,096,100	1/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	988,000		1,881,100
積み終了先	246,200	1/17以降の残り所要積立額	
超過準備	195,600	積数	1,218,800
非準備先残高	108,100	1日平均	40,600
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			1,881,100
準備預金進捗率	35.21%	(実績)	3.23% (日数)

1/15のマネタリーベース		1,964,400	
1/15コール	合計	180,664	無担 66,685 有担 113,979
コール前日増減	計	2,644	無担 1,439 有担 1,205

1/16の加重平均レート(速報)			1/15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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.055 ~0.125 (0.071)	0.040 ~0.050 (0.041)		O/N 0.060 ~0.145 (0.072)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.072 ~0.120 (0.090)			T/N	0.070 ~0.130 (0.082)		
			S/N			
0.295 (0.295)			1W			
0.150 ~0.270 (0.170)			2W			
			3W			
0.118 ~0.305 (0.147)		0.07-0.13	1M	0.100 ~0.118 (0.112)	有担先日付分	
		0.07-0.13	2M			
		0.07-0.13	3M			
		- 0.0600	6M			
		- 0.0560	1Y			

《オペ情報、入札結果》

全店共通	8,000億円	1/20 ~ 4/14 (84日間) 応札	3,000億円	落札	3,000億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
社債買入	1,000億円	1/22 応札	2,135億円	落札	873億円	按分レート	0.095%	5.7%	平均落札レート 0.127%
国債買入	2,500億円	1/20 応札	9,116億円	落札	2,507億円	按分利回り較差	0.003%	61.8%	平均利回り較差 0.003%
国債買入	2,500億円	1/20 応札	11,794億円	落札	2,504億円	按分利回り較差	0.009%	78.9%	平均利回り較差 0.009%
国債買入	2,000億円	1/20 応札	7,312億円	落札	2,004億円	按分利回り較差	0.017%	39.7%	平均利回り較差 0.019%
T-Bill3M	応札31兆6,842億円	落札5兆2,147億9,000万円(非競争入札:4,551億2,000万円)	1/20~4/21	0.0661%	按分8.8687%	平均0.0637%			

1/17の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,096,400	前日比	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。

16日のインターバンク市場動向
午前8時発表の準備預金先残高見込は86兆7,000億円。朝方の無担O/Nは、地銀、信託業態から0.065~0.07%近辺、大手行からは0.06%程度の調達希望。積みの初日ではあるものの、出合いの中心は0.07%前後と落ち着いた立ち上がりになった。一巡後はビッドが薄くなり、0.06~0.065%の出合いが若干見られる程度で、本日の取引を終えた。ターム物は調達ニーズに乏しく、引き続きロール案件での出合いが中心となった。

16日のオープン市場動向
現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は3M物の入札が実施され、平均落札利回0.0637%、按分落札利回0.0661%、按分比率8.8687%と軟調な市場を反映し、前回比で利回りは上昇した。WI取引では0.0630~0.0635%の出合いが見られ、セカンダリー市場では0.062~0.065%が出合うなど、総じて落ち着いた推移であった。CP市場は償還総額1,800億円に対し発行総額は2,200億円強。5・10日にかかる取引となったことで、幅広い業態から発行案件が見られた。発行レート水準は、特段目立った変化もなく、概ね横ばい圏で推移した。

- 17日の材料
- *月例経済報告
 - *11月のマネタリーサーベイ
 - *12月の消費動向調査
 - *米国12月の住宅着工件数
 - *米国12月の鉱工業生産・設備稼働率
 - *米国1月のミシガン大消費者信頼感指数速報
 - *流動性供給入札(3,000億円、1/21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	0.670	0.010	日経平均株価(終値)	15,747.20	▲ 61.53	為替(9時)	104.59-60
						為替(5時)	104.74-75

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	1/8	1/9	1/10	1/14	1/15	1/16
日銀当預残	1,101,600	1,065,100	1,107,100	1,094,000	1,053,400	1,096,100
準備預金残	990,800	970,300	1,005,700	999,300	968,700	988,000
レート	0.071%	0.073%	0.074%	0.072%	0.072%	0.071%
月中平均	0.06925%	0.06967%	0.07100%	0.07107%	0.07113%	0.07113%

「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