

<<資金需給>>

単位 億円

	17日需給速報		20日需給予想	21日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,500	1,700	2,000
財政		▲ 1,700	▲ 39,400	▲ 2,000
資金過不足		▲ 200	▲ 37,700	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			3,000	
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			7,100	
CP等買入				
		▲ 800	▲ 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		
国債補充供給				
小計		▲ 600	5,100	25,000
当増減		▲ 800	▲ 32,600	25,000

<< 1/20の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,062,700	前日比	▲ 32,600
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。

<< 17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85兆7,000億円。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%の調達希望。出合いの中心は0.07~0.071%となっており、昨日と同様に落ち着いた立ち上がりとなった。一巡後はビッド側が0.065%程度まで低下し、閑散な地合いで今週の取引を終えた。ターム物は、大手行が1W物0.117% 1M物0.118%で調達を行った。

<< 17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25,000億円で実施され、平均利回格差▲0.001%、按分利回較差▲0.002%、按分比率87.7%と落ち着いた結果になった。セカンダリー市場は3M:0.061~0.062%、6M:0.0575~0.058%、1Y:0.054%の出合いが見られ、逆イールドを引き続き形成している。CP市場は、償還総額300億円強に対し、発行総額は500億円弱と上回った。引き続き運用ニーズは堅調で、発行水準は特段目立った変化もなく落ち着いた推移した。

<< 20日の材料 >>
*11月の石油等消費動態統計
*11月の鉱工業生産・出荷・在庫指数確報
*米国市場休場(キング牧師生誕記念日)

<<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%

当座預金残高	1,095,300	1/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	989,000		1,219,400
積み終了先	816,700	1/20以降の残り所要積立額	
超過準備	548,000	積数	285,900
非準備先残高	106,300	1日平均	10,600
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	84.80% (実績)	12.90% (日数)	

JGB新発10年債	0.670	0.000	日経平均株価(終値)	15,734.46	▲ 12.74	為替(9時)	104.29-30
						為替(5時)	104.33-34

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	1/9	1/10	1/14	1/15	1/16	1/17
日銀当預残	1,065,100	1,107,100	1,094,000	1,053,400	1,096,100	1,095,300
準備預金残	970,300	1,005,700	999,300	968,700	988,100	989,000
レート	0.073%	0.074%	0.072%	0.072%	0.071%	0.071%
月中平均	0.06967%	0.07100%	0.07107%	0.07113%	0.07113%	0.07111%

1/16のマナタリベース				2,004,900
1/16コール	合計	178,963	無担	65,105
			有担	113,858
コール前日増減	計	▲ 1,701	無担	▲ 1,580
			有担	▲ 121

1/17の加重平均レート(速報)				1/16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	0.055 ~0.125 (0.071)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.071 ~0.120 (0.087)						T/N		0.072 ~0.120 (0.090)	
						S/N			
0.116 ~0.400 (0.126)						1W	0.295 (0.295)		
0.118 ~0.300 (0.170)						2W		0.150 ~0.270 (0.170)	
						3W			
0.118 (0.118)				0.07-0.13	-	1M	0.195 ~0.305 (0.250)	0.118 (0.118)	有担先日付分
				0.07-0.13	-	2M			
				0.07-0.13	0.061-0.062	3M			
				-	0.0575-0.0580	6M			
				-	0.0540	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入 25,000億円 1/21 応札 67,428億円 落札 25,010億円 按分利回り較差 -0.002% 87.7% 平均利回り較差 -0.001%
被災地支援(第33回) 1/23~2015/1/23 (365日間) 貸付予定総額 1億円(大手行 1億円、地域金融機関等 0億円) 貸付利率 0.10%
流動性供給 応札 7,833億円 落札 2,996億円 1/21 按分利回り較差 0.004% 按分 5.3763% 平均利回り較差 ▲0.003%

「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す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