

◀資金需給▶

単位 億円

	21日需給速報		22日需給予想		23日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,500	300	▲ 1,000		
財政		800	1,800	▲ 27,000		
資金過不足		2,300	2,100	▲ 28,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			1,700			
173,285			▲ 1,900			
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			5,100			
CP等買入						
		▲ 100	▲ 600			
貸出支援基金(成長)		34,599				
(増加)		50,859				
被災地支援		3,804			0	
社債等買入		▲ 100	900			
ETF買入		100				
国債補完供給						
小計		24,900	5,200	0		
当増減		27,200	7,300	▲ 28,000		

当座預金残高	1,090,100	1/21以降の残り所要積立額	246,400
準備預金残高	984,100	1/22以降の残り所要積立額	212,700
積み終了先	824,500	積数	212,700
超過準備	820,000	1日平均	8,500
非準備先残高	106,000		
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	88.69% (実績)	19.35% (日数)	

1/20のマナターペース		1,968,400	
1/20コール	合計	176,276	無担 66,538 有担 109,738
コール前日増減	計	903	無担 4,255 有担 ▲ 3,352

1/21の加重平均レート(速報)				1/20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 ~0.085 (0.071)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.085 (0.072)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.071 ~0.125 (0.094)				T/N	0.070 ~0.120 (0.081)		
				S/N	0.125 (0.125)		
0.117 ~0.118 (0.117)				1W	0.117 ~0.153 (0.124)		
0.077 ~0.340 (0.112)				2W	0.118 ~0.180 (0.124)		
				3W			
		0.07-0.13	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.07-0.13	0.0608-0.0638	2M			
		0.07-0.13	-	3M			
		-	-	6M			
		-	0.0540	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

CP買入 4,000億円 1/24 応札 9,189億円 落札 3,991億円 按分レート 0.082% 51.6% 平均落札レート 0.085%
 T-Bill2M 応札17兆986億万円 落札2兆3,048億5,000万円(非競争入札:1,950億9,000万円) 1/24~3/25 0.0638% 按分76.7617% 平均0.0626%
 5年利付国債(表面利率0.2%) 応札9兆2,261億円 落札2兆4,770億円(I非競争入札:2,195億円) 1/23~2018/12/20 0.208% 按分1.9176% 平均0.206%
 交付税特会 1兆500億円 1/30~7/31 応札 3兆2,257億円 落札 1兆500億円 0.102% 按分 13.0438% 平均 0.101%

◀ 1/22の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,097,400	前日比	7,300
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。

◀ 21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86兆円。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.07%近辺、大手行からは0.06%台前半の調達希望。出合いの中心は0.071%となった。一巡後はビッドが薄くなり、0.06~0.065%の出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、昨日に続き大手行が1W物で0.117%、2Wと1M物で0.118%で調達を行った。

◀ 21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2M物の入札が実施された。WI取引では0.0608~0.0625%の出合いが見られたが、落札結果は平均落札利回0.0626%、按分落札利回0.0638%、按分比率76.7617%と軟調な地合いを反映した結果となった。セカンダリー市場も0.0638%と按分利回水準での動き。CP市場は償還総額300億円弱に対し発行総額は1,200億円強に膨らんだ。発行レートは特段目立った変化もなく概ね横ばい圏で推移。CP等買入オペが実施され、平均落札レート0.085%、按分落札レート0.082%と前回比ほぼ横ばい圏での結果となった。

◀ 22日の材料 ▶
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
 *黒田日銀総裁定例会見
 *11月の景気動向指数改訂状況
 *ECB(欧州中銀)定例理事会

◀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)	104.24-25
0.680 0.020	15,795.96 154.28	為替(5時)	104.67-68

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	1/14	1/15	1/16	1/17	1/20	1/21
日銀当預残	1,094,000	1,053,400	1,096,100	1,095,300	1,062,900	1,090,100
準備預金残	999,300	968,700	988,100	989,100	964,800	984,100
レート	0.072%	0.072%	0.071%	0.071%	0.072%	0.071%
月中平均	0.07107%	0.07113%	0.07113%	0.07111%	0.07115%	0.07114%

「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