

<<資金需給>>

単位 億円

	23日需給速報		24日需給予想		27日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 700	▲ 700	▲ 700	▲ 1,000	
財政		▲ 24,700	▲ 700	▲ 10,000		
資金過不足		▲ 25,400	▲ 1,400	▲ 9,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					2,100	
173,093					▲ 1,400	
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						
国庫短期証売却						
国債買入						
CP等買入		▲ 200	▲ 200	4,000	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 34,599 (増加) 50,859						
被災地支援		0				
3,805						
社債等買入			▲ 100			
ETF買入						
国債補充供給						
小計		▲ 200	3,700	700		
当増減		▲ 25,600	2,300	▲ 8,300		

<< 1/24の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,074,700	前日比	2,300
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。

<< 23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83兆5,000億円。朝方の無担O/Nは、信託・地銀業態から0.07%台前半、大手行からは0.06%近辺での調達希望。出合いの中心は0.07~0.072%となった。一巡後は0.065~0.07%で若干の出合いが見られる程度で、午前の取引を終えた。後場に入るとベストビッドが0.065%まで低下し、特段目立った出合いもなく取引を終了した。ターム物に関しては、昨日に続き大手行が1W0.117%で調達を行った。

<< 23日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は強含み。短国市場は3M物の入札が実施された。WI取引で0.058~0.0585%での取引が見られ、落札結果は平均落札利回・按分落札利回共に0.0581%と強めの結果となった。セカンダリー市場では0.055~0.057%でのショートカバーが見られた。アウトライト市場では2M0.06%、3M0.055~0.0585%、6M0.055~0.057%、1Y0.050~0.055%での出合いが見られた。CP市場は、償還総額1,600億円程度に対し発行総額は1,800億円程度。鉄鋼業態からまとまった発行案件がみられた。発行レートは特段目立った動きもなく、概ね横ばい圏での動きとなった。

<< 24日の材料 >>
 *特にありません

当座預金残高	1,072,400	1/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	968,700		186,500
積み終了先	819,100	1/24以降の残り所要積立額	
超過準備	817,400	積数	165,000
非準備先残高	103,700	1日平均	7,200
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	91.23% (実績)		25.81% (日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	104.65-66
0.655 ▲ 0.020	15,695.89 ▲ 125.07	為替(5時)	104.34-35

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	1/16	1/17	1/20	1/21	1/22	1/23
日銀当預残	1,096,100	1,095,300	1,062,900	1,090,100	1,098,000	1,072,400
準備預金残	988,100	989,100	964,800	984,100	986,700	968,700
レート	0.071%	0.071%	0.072%	0.071%	0.071%	0.072%
月中平均	0.07113%	0.07111%	0.07115%	0.07114%	0.07114%	0.07117%

1/22のマネタリーベース		2,001,800	
1/22コール 合計	177,450	無担	64,727
有担	112,723		
コール前日増減 計	1,395	無担	530
有担	865		

1/23の加重平均レート(速報)				1/22の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分	
0.055 ~ 0.145 (0.072)	0.040 ~ 0.050 (0.041)			O/N	0.060 ~ 0.085 (0.071)			0.040 ~ 0.050 (0.041)	
0.072 ~ 0.120 (0.093)				T/N		0.070 ~ 0.125 (0.084)			
				S/N					
0.100 ~ 0.117 (0.111)				1W		0.117 (0.117)			
				2W		0.180 (0.180)			
				3W					
0.100 ~ 0.118 (0.111)		0.07-0.13	-	1M		0.118 (0.118)		有担先日付分	
		0.07-0.13	0.0600	2M					
		0.07-0.13	0.0550-0.0585	3M					
		-	0.0550-0.0570	6M					
		-	0.0500-0.0550	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 1/27 ~ 4/21 (84日間) 応札 2,070億円 落札 2,070億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-BIII3M 応札33兆1,678億円 落札5兆2,584億6,000万円(非競争入札:4,614億円) 1/27~4/28 0.0581% 按分44.7895% 平均0.0581%
 20年利付国債(表面利率1.6%)応札5兆7,953億円落札1兆897億円(I 非競争入札:1,094億円) 1/27~2033/12/20 1.540%按分24.7372%平均1.538%

「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