

◀資金需給▶

単位 億円

	24日需給速報		27日需給予想	28日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	1,100	1,000
財政		▲ 200	▲ 17,000	1,000
資金過不足		▲ 800	▲ 15,900	2,000
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				25,000
国庫短期証売却				
国債買入				7,000
CP等買入		4,000		
		▲ 200	▲ 800	
貸出支援基金 (成長) 34,599 (増加) 50,859				
被災地支援				
3,805				
社債等買入		▲ 100	▲ 500	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		3,700	▲ 600	32,000
当預増減		2,900	▲ 16,500	34,000

当座預金残高	1,075,300	1/24以降の残り所要積立額	165,000
準備預金残高	974,400	1/27以降の残り所要積立額	
積み終了先	828,100	積数	111,800
超過準備	824,000	1日平均	5,600
非準備先残高	100,900	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	94.06% (実績)		35.48% (日数)

1/23のマネタリーベース		1,977,000	
1/23コール	合計	180,214	無担 65,930 有担 114,284
コール前日増減	計	2,764	無担 1,203 有担 1,561

1/24 の加重平均レート(速報)				1/23 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
0.055 ~0.145 (0.072)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.055 ~0.145 (0.072)			0.040 ~0.050 (0.041)
0.072 ~0.120 (0.082)					0.072 ~0.120 (0.093)		
0.117 ~0.400 (0.235)					0.100 ~0.118 (0.115)		
0.170 ~0.330 (0.216)							
		0.07-0.13	-	1M	0.100 ~0.118 (0.111)		有担先日付分
		0.07-0.13	-	2M	0.280 (0.280)		
		0.07-0.13	0.052-0.055	3M			
		-	-	6M			
		-	0.048-0.050	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国短買入	25,000億円	1/28	応札	54,429億円	落札	25,009億円	按分利回り較差	-0.004%	6.4%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	2,500億円	1/28	応札	7,472億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	0.003%	97.9%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,500億円	1/28	応札	11,619億円	落札	2,500億円	全取利回り較差	-0.001%		平均利回り較差	0.000%
国債買入	2,000億円	1/28	応札	5,995億円	落札	2,005億円	按分利回り較差	-0.025%	49.1%	平均利回り較差	-0.021%
ETF買入	128億円	約定日	1/24								
J-REIT買入	3億円	約定日	1/24								

◀ 1/27の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,058,800	前日比	▲ 16,500
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。

◀ 24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83兆8,000億円。朝方の無担O/Nは、地銀、信託業態から0.07~0.07%台前半、大手行からは0.06%台前半の調達希望。朝方の出合いの中心は0.072%となった。一巡後もさほど調達レートは低下せず、0.07%近辺での出合いが若干見られつつ、前場の取引を終了した。後場に入ると徐々にビッドが消え、出合い閑散となって今週の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1M物0.118%で調達を行った。

◀ 24日のオープン市場動向 ▶  
 現先S/N物は横ばい圏で強含み。短国市場は、短国買入オペ2兆5,000億円が実施され、平均利回較差▲0.002%、按分利回較差▲0.004%と堅調な結果に。アウトライト市場は、3M物で0.05~0.055%、6M~1Y物で0.045~0.05%の出合いが見られるなど、全体的に強含みとなった。CP市場は償還総額900億円程度に対し発行総額は1,000億円程度。発行レートは上昇基調で推移するも、0.10%近辺では投資家の買いニーズが強く、狭いレンジでの推移となっている。

◀ 27日の材料 ▶  
 \*日銀金融政策決定会合議事要旨(12月19、20日開催分)  
 \*12月の貿易統計  
 \*米国12月の新築一戸建て販売件数

JGB新発10年債	0.630	▲ 0.025	日経平均株価(終値)	15,391.56	▲ 304.33	為替(9時)	103.38-39
						為替(5時)	103.36-37

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	1/17	1/20	1/21	1/22	1/23	1/24
日銀当預残	1,095,300	1,062,900	1,090,100	1,098,000	1,072,400	1,075,300
準備預金残	989,100	964,800	984,100	986,700	968,700	974,400
レート	0.071%	0.072%	0.071%	0.071%	0.072%	0.072%
月中平均	0.07111%	0.07115%	0.07114%	0.07114%	0.07117%	0.07127%

「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(登命)第526号 日本証券業協会加入