

<<資金需給>>

単位 億円

	5日需給速報		6日需給予想	7日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		7,900	7,100	7,000
財政		▲ 300	100	▲ 21,000
資金過不足		7,600	7,200	▲ 14,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,400		
78,671		▲ 3,300		
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			13,200	4,500
CP等買入				
		▲ 700		
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789				
被災地支援				
3,251				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 1,600	13,200	4,500
当預増減		6,000	20,400	▲ 9,500
当座預金残高	1,787,400	1/5以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,617,500	10,400		
積み終了先	1,309,700	1/6以降の残り所要積立額		
超過準備	1,309,700	積数		
非準預先残高	169,900	1日平均		
		900		
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)		1,965,100		
準備預金進捗率	99.54%	(実績)	67.74%	(日数)

<< 1/6の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,807,800	前日比	20,400
O/N	0.06~0.075	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.07%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 5日のインターバンク市場動向 >>
 午前8時発表の準備預金残高見込みは、131兆3,000億円(当座預金残高見込みは178兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07~0.073%程度、大手行業態から0.065~0.068%の調達希望で始まり、年末と同様にやや強めの立ち上がりとなった。一巡後の出合いは、0.07%前後で推移した。その後、ビッドは徐々に薄くなり、出合いの水準は午後までに0.065%に低下した。ターム物に関しては、大手行が1W0.117%、2W・1M0.118%で調達を行った。

<< 5日のオープン市場動向 >>
 短国現先レートは年末から横ばい圏で、引き続き高めの水準で推移した。短国アウトライト市場では、6日の3M入札を控えて調整の売りが散見され、3Mで0.02~0.025%で小額の出合いが見られた。CP市場は償還総額1,200億円程度に対し、鉄鋼・電機業態から大型の発行案件が見られたことで、発行総額は1,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での取引となった。

- << 6日の材料 >>
- *12月のマネタリーベース
 - *12月実績/1月見込み財政資金対民間収支
 - *米国11月の製造業新規受注・出荷・在庫
 - *米国12月のISM非製造業景況指数
 - *国庫短期証券入札(3ヵ月、57,000億円、1/8発行)
 - *10年利付国債入札(24,000億円、1/8発行)

<<コール12月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06745%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06776%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.40-42
0.320 ▲ 0.005	17,408.71 ▲ 42.06	為替(5時)	120.38-39

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	12/24	12/25	12/26	12/29	12/30	1/5
日銀当預残	1,784,800	1,796,500	1,790,600	1,781,800	1,781,400	1,787,400
準備預金残	1,624,500	1,631,000	1,627,000	1,615,300	1,616,900	1,617,500
レート	0.067%	0.068%	0.068%	0.068%	0.066%	0.070%
月中平均	0.06746%	0.06748%	0.06754%	0.06755%	0.06745%	0.06680%

12/30のマネタリーベース		2,758,800	
12/30コール 合計	167,469	無担	51,928
有担	115,541		
コール前日増減	▲ 17,018	無担	▲ 14,748
有担	▲ 2,270		

1/5の加重平均レート(速報)				12/30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	有担先日付分	
0.050 ~0.075 (0.070)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.080 (0.066)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.067 ~0.120 (0.077)				T/N	0.120	(0.120)		
				S/N				
0.060 ~0.260 (0.088)				1W				
0.116 ~0.160 (0.122)				2W	0.118	(0.118)		
0.118 (0.118)				3W	0.118	(0.118)		
0.118 ~0.260 (0.120)		0.08-0.12	-	1M	0.118	(0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.02-0.025	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	700億円	1/7	応札	3,149億円	落札	701億円	按分利回り較差	0.015%	3.5%	平均利回り較差	0.021%
国債買入	2,400億円	1/7	応札	6,349億円	落札	2,407億円	按分利回り較差	-0.003%	77.8%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	1,400億円	1/7	応札	4,634億円	落札	1,403億円	按分利回り較差	0.005%	25.1%	平均利回り較差	0.006%
ETF買入	374億円	約定日	1/5								

「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

あけましておめでとうございます。本年もよろしくお願ひ申し上げます。