

◀ 資金需給 ▶

単位 億円

	6日需給速報		7日需給予想	8日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		7,100	5,500	4,000
財政		▲ 100	▲ 19,300	▲ 32,000
資金過不足		7,000	▲ 13,800	▲ 28,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
78,671				
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	5,000	
CP等買入			▲ 100	
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		13,200	4,900	0
当預増減		20,200	▲ 8,900	▲ 28,000
当座預金残高	1,807,600	1/6以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,637,500	9,000		
積み終了先	1,327,200	1/7以降の残り所要積立額		
超過準備	1,327,200	積数 8,000		
非準預先残高	170,100	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	99.59% (実績)	70.97% (日数)		

◀ 1/7の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,798,700	前日比	▲ 8,900
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%程度での出会いが中心になると見込まれる。

◀ 6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、132兆6,000億円(当座預金残高見込みは180兆8,000億円)。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、昨日と同様にやや強めの立ち上がりとなった。一巡後の出会いは、0.07%前後で推移した。午後のお出合いは調整程度で一日の取引を終えた。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。

◀ 6日のオープン市場動向 ▶
 短国現先レートは発行日要因でやや上昇した。短国3M物の入札は平均、按分落札利回り共に0.00%、按分比率80.5632%という結果になった。事前の気配と比較して強めの落札結果となったことで、セカンダリーではショートカバーから▲0.09~▲0.05%の出会いとなった。CP市場は償還総額300億円程度に対し、発行総額は800億円程度となった。通信業態から大型の発行案件が見られた。発行レートは引続き横ばい圏の動きとなった。

- ◀ 7日の材料 ▶
- *1月の日銀当座預金増減要因見込み
 - *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
 - *米国11月の貿易収支
 - *ユーロ圏12月の消費者物価指数速報値
 - *交付税特別会計借入(10,500億円、1/16借入)

◀ 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)	119.41-42
0.280 ▲ 0.040	16,883.19 ▲ 525.52	為替(5時)	119.18-19

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	12/25	12/26	12/29	12/30	1/5	1/6
日銀当預残	1,796,500	1,790,600	1,781,800	1,781,400	1,787,400	1,807,600
準備預金残	1,631,000	1,627,000	1,615,300	1,616,900	1,621,800	1,637,500
レート	0.068%	0.068%	0.068%	0.066%	0.070%	0.071%
月中平均	0.06748%	0.06754%	0.06755%	0.06745%	0.06680%	0.06750%

1/5のマネタリーベース				2,756,800
1/5コール	合計	185,284	無担 69,927	有担 115,357
コール前日増減	計	17,815	無担 17,999	有担 ▲ 184

1/6の加重平均レート(速報)				1/5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		
0.055 ~0.125 (0.071)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.075 (0.070)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.070 ~0.120 (0.099)				T/N	0.067 ~0.120 (0.077)			
				S/N				
0.117 (0.117)				1W 0.060 ~0.065 (0.063)	0.117 ~0.260 (0.121)			
0.114 ~0.310 (0.133)				2W	0.116 ~0.160 (0.120)			
				3W	0.118 (0.118)			
0.118 ~0.295 (0.121)		0.08-0.12	-	1M 0.260 (0.260)	0.118 ~0.120 (0.118)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲ 0.09-▲ 0.05	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

◀ オペ情報、入札結果 ▶

米ドル資金供給(固定金利方式) 1/8~1/15(7日間) 応札なし 貸付利率 0.610%
 T-Bill3M 応札30兆5,099億1,000万円 落札5兆2,779億8,000万円(非競争入札:4,520億円) 1/8~4/6 0.000% 按分80.5632% 平均0.000%
 10年利付国債(表面利率0.3%) 応札7兆,4971億円 落札2兆1,893億円(I非競争入札:2,063億円) 1/8~2024/12/20 0.298% 按分92.0422% 平均0.295%
 ETF買入 341億円 約定日 1/6
 J-REIT買入 12億円 約定日 1/6

「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