

<<資金需給>>

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想		9日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		5,800		3,500		3,000
財政		▲ 19,100		▲ 33,100		2,000
資金過不足		▲ 13,300		▲ 29,600		5,000
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						25,000
国庫短期証売却						
国債買入		5,000				12,000
CP等買入						
		▲ 100		▲ 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						100
国債補完供給						
小計		4,900		0		37,000
当増減		▲ 8,400		▲ 29,600		42,000

当座預金残高	1,799,200	1/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,640,500		8,000
積み終了先	1,330,300	1/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,330,300	積数	6,400
非準備先残高	158,700	1日平均	800
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	99.67%	(実績)	74.19% (日数)

1/6のマナターベース		2,769,900	
1/6コール	合計	200,066	無担 79,286 有担 120,780
コール前日増減	計	14,782	無担 9,359 有担 5,423

1/7の加重平均レート(速報)				1/6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	O/N	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.055 ~0.135 (0.073)	0.030	~0.040 (0.031)				0.055 ~0.125 (0.071)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.070 ~0.120 (0.092)						T/N		0.070 ~0.120 (0.099)	
0.079 (0.079)						S/N			
0.093 ~0.117 (0.115)						1W		0.117 (0.117)	
0.115 ~0.340 (0.129)						2W		0.114 ~0.310 (0.127)	
0.140 ~0.300 (0.208)						3W			
0.080 ~0.225 (0.135)				0.08-0.12	-	1M		0.118 ~0.295 (0.119)	有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	▲0.075-▲0.065	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	1/7	~ 1/8 (1日間)	応札	1億円	落札	1億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	25,000億円	1/9		応札	66,130億円	落札	25,001億円	按分利回り較差	0.014%	26.5%	平均利回り較差	0.021%
国債買入	4,000億円	1/9		応札	9,181億円	落札	4,000億円	全取利回り較差	0.011%		平均利回り較差	0.012%
国債買入	4,000億円	1/9		応札	8,063億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	0.003%	70.5%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	4,000億円	1/9		応札	12,222億円	落札	4,011億円	按分利回り較差	-0.002%	13.6%	平均利回り較差	-0.001%
交付税特会	1兆500億円	1/16~7/16		応札	3兆1,550億円	落札	1兆500億円	0.092%	按分	52.000%	平均	0.089%

<< 1/8の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,769,600	前日比	▲ 29,600
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。

<< 7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179兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態から0.07~0.075%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。午後に入ってから引続き0.07~0.075%程度の強めの地合いで推移し、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。

<< 7日のオープン市場動向 >>
 短国現先レートは前日からほぼ変わらず。短国アウトライト市場では3M ▲0.075~▲0.065%の出合いが見られた。短国買入オペは2兆5000億円でおファーされ、按分利回り較差+0.014%、平均利回り較差+0.021%、按分比率26.5%と、やや甘めの結果となった。CP市場は発行が五・十日にあたり、鉄鋼・通信・金融業態から大型案件が見られたため、発行総額は2,300億円程度となった。発行レートは足元金利の高止まりから小幅に上昇する展開となった。

<< 8日の材料 >>
 *MPC (英中銀金融政策委員会、2日目)
 *米国11月の消費者信用残高
 *国庫短期証券入札(3ヵ月、57,000億円、1/13発行)
 *10年物価連動国債入札(5,000億円、1/13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	0.300	0.020	日経平均株価(終値)	16,885.33	2.14	為替(9時)	118.65-67
						為替(5時)	119.04-05

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	12/26	12/29	12/30	1/5	1/6	1/7
日銀当預残	1,790,600	1,781,800	1,781,400	1,787,400	1,807,600	1,799,200
準備預金残	1,627,000	1,615,300	1,616,900	1,621,800	1,639,600	1,640,500
レート	0.068%	0.068%	0.066%	0.070%	0.071%	0.073%
月中平均	0.06754%	0.06755%	0.06745%	0.06680%	0.06750%	0.06829%

「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