

**<<資金需給>>**

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想		13日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		3,600	2,000	4,000		
財政		▲ 33,500	3,100	▲ 10,000		
資金過不足		▲ 29,900	5,100	▲ 6,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					900	
78,671					▲ 1,500	
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			12,200			
CP等買入						
		▲ 100	▲ 600			
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	100			
国債補完供給						
小計		0	36,700	▲ 600		
当預増減		▲ 29,900	41,800	▲ 6,600		

当座預金残高	1,769,300	1/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,615,800		6,400
積み終了先	1,305,300	1/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,305,300	積数	5,500
非準預先残高	153,500	1日平均	800
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)	1,977,100		
準備預金進捗率	99.72% (実績)	77.42% (日数)	

1/7のマネタリーベース		2,755,800	
1/7コール	合計	201,704	無担 80,960 有担 120,744
コール前日増減	計	1,638	無担 1,674 有担 ▲ 36

1/8の加重平均レート(速報)			1/7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	
0.050 ~0.125 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.135 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.120 (0.120)					0.070 ~0.120 (0.092)		
					0.079 (0.079)		
0.068 ~0.260 (0.131)					0.093 ~0.117 (0.115)		
0.115 ~0.116 (0.115)					0.115 ~0.340 (0.129)		
0.118 (0.118)					0.140 ~0.300 (0.208)		
0.118 ~0.220 (0.140)		0.08-0.12	-		0.080 ~0.225 (0.131)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-				
0.200 (0.200)		0.08-0.12	▲0.02-0.00				
		-	-				
		-	-				

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通	8,000億円	1/13 ~ 4/13 (90日間)	応札 910億円	落札 910億円	0.100%	全取	平均 0.100% (固定)
国債補完	2,000億円	1/8 ~ 1/9 (1日間)	応札 1億円	落札 1億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
T-Bill3M	応札31兆9,046億円	落札5兆1,972億3,000万円(非競争入札:4,527億円)	1/13~4/13	0.0000%	按分5.5362%	平均 ▲0.0044%	
10年物価連動国債(表面利率0.1%)	応札 1兆4,868億円	落札 4,998億円	1/13~2024/9/10	▲0.501%	按分 83.0708%		

「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

<< 1/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,811,100	前日比	41,800
O/N	0.06~0.08	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.07%台での出合いが中心になると見込まれる。

**<< 8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、130兆8,000億円(当座預金残高見込みは177兆円)。朝方の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態から0.07~0.076%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。その後も、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。

**<< 8日のオープン市場動向 >>**  
 短国現先レートは短国発行要因から、レートは上昇気味であった。短国3M物の入札が実施され、按分落札利回0.00%、平均落札利回▲0.0044%、按分比率5.5362%という結果となった。WI取引では▲0.02~▲0.014%の出合いと警戒感があつたものの、落札結果は無難という印象であった。セカンダリーでは0.00%の出合いが見られた。CP市場は幅広い業態から発行案件が見られ、償還総額1,300億円程度に対して発行総額は2,700億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏との印象であった。

**<< 9日の材料 >>**  
 \*11月の景気動向指数速報  
 \*12月のマネタリーベースと日本銀行の取引  
 \*米国11月の卸売売上高 \*米国12月の雇用統計  
 \*国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、1/14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	0.285	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	17,167.10	281.77	為替(9時)	119.28-30
						為替(5時)	119.80-81

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	12/29	12/30	1/5	1/6	1/7	1/8
日銀当預残	1,781,800	1,781,400	1,787,400	1,807,600	1,799,200	1,769,300
準備預金残	1,615,300	1,616,900	1,621,800	1,639,600	1,641,500	1,615,800
レート	0.068%	0.066%	0.070%	0.071%	0.073%	0.074%
月中平均	0.06755%	0.06745%	0.06680%	0.06750%	0.06829%	0.06900%