

◀資金需給▶

単位 億円

	13日需給速報		14日需給予想		15日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		3,600		3,300		2,000
財政		▲ 15,300		▲ 23,700		▲ 18,000
資金過不足		▲ 11,700		▲ 20,400		▲ 16,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		900				
78,040		▲ 1,500				
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						30,000
国庫短期証売却						
国債買入				12,200		4,700
CP等買入						3,500
		▲ 400		▲ 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	即日	▲ 300		300		
小計		▲ 1,200		12,400		38,200
当預増減		▲ 12,900		▲ 8,000		22,200
当座預金残高	1,798,200	1/13以降の残り所要積立額				
準備預金残高	1,641,100	3,100				
積み終了先	1,335,400	1/14以降の残り所要積立額				
超過準備	1,335,400	積数				
非準備先残高	157,100	1日平均				
		900				
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	99.91%	(実績)	93.55%	(日数)		

◀ 1/14の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,790,200	前日比	▲ 8,000
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%程度の出合いが中心になると見込まれる。

◀ 13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、134兆1,000億円(当座預金残高見込みは180兆円)。朝方の無担O/Nは、大手行から0.068~0.07%程度、地銀・信託業態から0.07~0.075%の調達希望で始まった。その後も、0.07~0.075%中心で推移し、一日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W 0.117%、2W・1M 0.118%で調達を行った。

◀ 13日のオープン市場動向 ▶  
 現先レートS/Nはやや低下した。短国買入オペは30,000億円が通知された。前回から5,000億円の増額となったものの、応札額は86,453億円と膨らんだことから、平均利回較差+0.022%、按分利回較差+0.020%、按分率17.0%と軟調な結果となった。オペ後は3M物で▲0.055%での出合いが見られた程度にとどまった。CP市場は電機・通信業態でまとまった発行が見られたことに加え、15日発行となったことから、発行総額は1,800億円程度まで膨らんだ。発行レートは月内物を中心に高止まりとなった。

◀ 14日の材料 ▶  
 \*12月のマネーストック  
 \*米国ページブック  
 \*米国11月の企業在庫 \*米国12月の小売売上高  
 \*30年利付国債入札(7,000億円、1/16発行)  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、1/22借入)

JGB新発10年債	0.265	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,087.71	▲ 110.02	為替(9時)	118.31-33
						為替(5時)	118.24-25

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	1/5	1/6	1/7	1/8	1/9	1/13
日銀当預残	1,787,400	1,807,600	1,799,200	1,769,300	1,811,100	1,798,200
準備預金残	1,621,800	1,639,600	1,641,500	1,616,700	1,648,800	1,641,100
レート	0.070%	0.071%	0.073%	0.074%	0.075%	0.074%
月中平均	0.06680%	0.06750%	0.06829%	0.06900%	0.07100%	0.07123%

1/9のマネタリーベース			2,761,900			
1/9コール	合計	200,810	無担	85,273	有担	115,537
コール前日増減	計	▲ 1,810	無担	▲ 310	有担	▲ 1,500

1/13の加重平均レート(速報)				1/9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	
0.060	~0.125 (0.074)	0.030	~0.040 (0.031)			O/N	0.060	~0.135 (0.075)	0.030	~0.040 (0.031)
0.073	~0.120 (0.083)					T/N				
						S/N		0.077	~0.120 (0.086)	
0.117	(0.117)					1W		0.084	~0.125 (0.103)	
0.118	(0.118)					2W		0.118	~0.310 (0.150)	
						3W				
0.118	~0.225 (0.162)			0.08-0.12	-	1M		0.118	(0.118)	有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M				
0.118	(0.118)			0.08-0.12	▲0.055	3M				
				-	-	6M		0.300	(0.300)	
				-	-	1Y				

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	30,674億円	1/13	~ 1/14 (1日間)	応札	324億円	落札	324億円	-0.400%	全取	平均	-0.400%(即)	
国短買入	30,000億円	1/15		応札	86,453億円	落札	30,000億円	按分利回り較差	0.020%	17.0%	平均利回り較差	0.022%
国債買入	700億円	1/15		応札	2,511億円	落札	701億円	按分利回り較差	0.008%	49.7%	平均利回り較差	0.011%
国債買入	4,000億円	1/15		応札	11,580億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	-0.011%	18.4%	平均利回り較差	-0.009%

米ドル資金供給(固定金利方式) 1/15~1/23 (8日間) 応札 1,000万ドル 落札 1,000万ドル 貸付利率 0.610%

ETF買入 341億円 約定日 1/13

「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