

<<資金需給>>

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想		19日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		2,200	1,200	2,000		
財政		▲ 18,100	▲ 4,800	▲ 11,000		
資金過不足		▲ 15,900	▲ 3,600	▲ 9,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					800	
78,040					▲ 1,700	
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		4,700			11,800	
CP等買入		3,500				
		▲ 500	▲ 800			
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	即日	▲ 100				
		100	100			
小計		37,800	▲ 600	10,900		
当預増減		21,900	▲ 4,200	1,900		

当座預金残高	1,814,000	1/15以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,645,600		500
積み終了先	1,337,700	1/16以降の残り所要積立額	
超過準備	1,337,200	積数	1,977,100
非準預先残高	168,400	1日平均	63,800
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			1,977,100
1月の新所要見込		63,800	(一日平均)

1/14のマネタリーベース		2,735,700	
1/14コール	合計 204,908	無担 85,469	有担 119,439
コール前日増減	計 ▲ 127	無担 1,007	有担 ▲ 1,134

1/15の加重平均レート(速報)				1/14の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.053 ~0.090 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.050 ~0.080 (0.073)			0.030 ~0.040 (0.031)
0.076 ~0.120 (0.086)				T/N		0.075 ~0.120 (0.079)		
0.117 (0.117)				S/N		0.125 (0.125)		
0.118 (0.118)				1W		0.117 (0.117)		
0.118 ~0.280 (0.125)				2W		0.083 ~0.118 (0.090)		
				3W				
				1M		0.118 (0.118)		有担先日付分
				2M				
0.119 (0.119)				3M				
				6M				
				1Y				

<< 1/16の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,809,800	前日比	▲ 4,200
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。					

<< 15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、134兆6,000億円(当座預金残高見込みは181兆3,000億円)。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。その後の出合いの水準は、0.07~0.073%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1W0.117%、2W・1M0.118%で調達を行った。

<< 15日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばい圏での推移となった。短国3M物の入札は平均落札利回▲0.0048%、按分落札利回▲0.0020%、按分率11.8277%と概ね事前予想通りの堅調な入札となった。セカンダリーでは、▲0.017~▲0.01%の出合いが見られた。CP市場は、引き続き電機・鉄鋼業態を中心に発行が見られたが、発行総額は1,100億円程度にとどまった。発行レートも特段変化は見られなかった。

- << 16日の材料 >>
- *11月のマネタリーサーベイ
 - *11月の第3次産業活動指数
 - *米国12月の消費者物価指数
 - *米国12月の鉱工業生産・設備稼働率
 - *米国1月のミシガン大消費者信頼感指数速報
 - *ユーロ圏12月の消費者物価指数改定値
 - *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、1/20発行)
 - *流動性供給入札(3,000億円、1/20発行)

<<コール12月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06903%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06961%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	117.42-44
0.250	0.000	為替(5時)	117.66-68

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	1/7	1/8	1/9	1/13	1/14	1/15
日銀当預残	1,799,200	1,769,300	1,811,100	1,798,200	1,792,100	1,814,000
準備預金残	1,641,500	1,616,700	1,648,800	1,642,100	1,639,100	1,645,600
レート	0.073%	0.074%	0.075%	0.074%	0.073%	0.074%
月中平均	0.06829%	0.06900%	0.07100%	0.07123%	0.07136%	0.07153%

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	1/19 ~ 4/20 (91日間)	応札 760億円	落札 760億円	0.100%	全取	平均 0.100%	(固定)
国債補完	4,000億円	1/15 ~ 1/16 (1日間)	応札 70億円	落札 70億円	-0.400%	全取	平均 -0.400%	(即)
国債買入	4,000億円	1/19	応札 10,933億円	落札 4,006億円	按分利回り較差 0.008%	49.0%	平均利回り較差 0.008%	
国債買入	4,000億円	1/19	応札 9,993億円	落札 4,003億円	按分利回り較差 0.006%	66.3%	平均利回り較差 0.007%	
国債買入	2,400億円	1/19	応札 5,928億円	落札 2,409億円	按分利回り較差 -0.007%	37.0%	平均利回り較差 -0.004%	
国債買入	1,400億円	1/19	応札 4,200億円	落札 1,402億円	按分利回り較差 -0.019%	76.7%	平均利回り較差 -0.014%	
社債買入	1,000億円	1/21	応札 1,268億円	落札 1,002億円	按分レート 0.000%	5.5%	平均落札レート 0.028%	
T-Bill3M	応札34兆1,591億2,000万円	落札5兆2,155億2,000万円(非競争入札:4,544億円)	1/19~4/20	▲0.0020%	按分11.8277%	平均▲0.0048%		

「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