

<<資金需給>>

単位 億円

	16日需給速報		19日需給予想	20日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,300	2,200	1,000
財政		▲ 5,400	▲ 16,700	▲ 21,000
資金過不足		▲ 4,100	▲ 14,500	▲ 20,000
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				
国庫短期証売却				
国債買入			12,500	
CP等買入				
		▲ 800	▲ 200	
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	300	
国債補充供給		100		
小計		▲ 600	11,700	0
当預増減		▲ 4,700	▲ 2,800	▲ 20,000

当座預金残高	1,809,300	1/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,642,300		1,978,000
積み終了先	1,265,500	1/19以降の残り所要積立額	
超過準備	763,500	積数	258,500
非準備先残高	167,000	1日平均	9,200
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			1,978,000
準備預金進捗率	86.93% (実績)		9.68% (日数)

1/15のマナターベース		2,755,300	
1/15コール合計	201,562	無担	82,645
有担			118,917
コール前日増減	計	▲ 3,346	無担 ▲ 2,824
			有担 ▲ 522

1/16の加重平均レート(速報)				1/15の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.060 ~ 0.135 (0.074)	0.030 ~ 0.040 (0.031)			0.053 ~ 0.090 (0.074)			0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.074 ~ 0.125 (0.087)						0.076 ~ 0.120 (0.086)	
0.065 ~ 0.260 (0.108)						0.117 (0.117)	
						0.118 (0.118)	
0.170 (0.170)		0.08-0.12	-			0.118 ~ 0.280 (0.124)	有担先日付分
		0.08-0.12	-				
		0.08-0.12	▲0.04-▲0.03			0.119 (0.119)	
		-	▲0.03				
		-	▲0.02-▲0.0119				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 4,000億円 1/16 ~ 1/19 (3日間) 応札 2億円 落札 2億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 T-Bill1Y 応札1兆8兆5,955億円 落札2兆2,995億5,000万円(非競争入札:2,004億円) 1/20~2016/1/20 ▲0.0119% 按分5.4545% 平均▲0.0169%
 流動性供給 応札 7,256億円 落札 2,996億円 1/20 募入最大利回較差 ▲0.014% 按分 16.4705% 募入平均利回較差 ▲0.018%
 被災地支援(第45回) 1/23~2016/1/22 (364日間) 貸付予定総額 2億円(大手行 2億円、地域金融機関等 0億円) 貸付利率 0.10%
 ETF買入 341億円 約定日 1/16
 J-REIT買入 12億円 約定日 1/16

<< 1/19の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,806,500	前日比	▲ 2,800
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%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 16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、前日比1兆1,000億円減少の133兆5,000億円(当座預金残高見込みは181兆円)。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0.07~0.077%の調達希望で始まった。一巡後の出合いの水準は、0.07~0.073%中心で推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、証券業態のロール案件が散見された。

<< 16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1Y物の入札は平均落札利回 ▲0.0169%、按分落札利回▲0.0119%、按分率5.4545%と強めの結果となった。セカンダリーでは▲0.02~▲0.015%での出合いが見られた。その他、3M物で▲0.04~▲0.03%、6M物で▲0.03%での出合いが見られた。CP市場は20日発行にあたったため、発行総額は3,400億円程度まで膨らんだ。複数の小売、鉄鋼業態等からまとまった額の発行があったものの、発行レートは横ばい圏内にとどまった。

<< 19日の材料 >>

- *11月の石油等消費動態統計
- *12月の消費動向調査
- *米国祝日 (Martin L. King Jr.'s Day)

<<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)	116.13-15
0.240 ▲ 0.010	16,864.16 ▲ 244.54	為替(5時)	116.54-55

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	1/8	1/9	1/13	1/14	1/15	1/16
日銀当預残	1,769,300	1,811,100	1,798,200	1,792,100	1,814,000	1,809,300
準備預金残	1,616,700	1,648,800	1,642,100	1,639,100	1,646,400	1,642,300
レート	0.074%	0.075%	0.074%	0.073%	0.074%	0.074%
月中平均	0.06900%	0.07100%	0.07123%	0.07136%	0.07153%	0.07194%

「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