

<<資金需給>>

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想		21日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		2,100		1,400		0
財政		▲ 17,000		▲ 22,200		3,000
資金過不足		▲ 14,900		▲ 20,800		3,000
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		800				
77,139		▲ 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		12,500				7,800
CP等買入						
		▲ 200		▲ 500		
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						1,000
ETF買入		300				
国債補完供給						
小計		11,700		▲ 500		38,800
当増減		▲ 3,200		▲ 21,300		41,800
当座預金残高	1,806,100		1/19以降の残り所要積立額			
準備預金残高	1,642,000			258,500		
積み終了先	1,276,400		1/20以降の残り所要積立額			
超過準備	1,269,800		積数	192,100		
非準備先残高	164,100		1日平均	7,100		
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	90.29%	(実績)	12.90%	(日数)		

1/16のマナタリーベース		2,749,200	
1/16コール 合計	204,645	無担	83,594
コール前日増減	計	3,083	無担
			949
			有担
			2,134

1/19の加重平均レート(速報)				1/16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)			O/N	0.060 ~0.135 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.075 ~0.125 (0.094)				T/N		0.074 ~0.125 (0.087)	
				S/N			
0.114 ~0.135 (0.123)				1W		0.065 ~0.260 (0.108)	
0.118 (0.118)				2W			
				3W			
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.170 (0.170)		有担先日付分
		0.08-0.12	0.0100	2M			
		0.08-0.12	▲0.045-▲0.040	3M			
		-	-	6M		0.145 (0.145)	
		-	▲0.025	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	30,000億円	1/21	応札	76,064億円	落札	30,000億円	按分利回り較差	0.020%	77.3%	平均利回り較差	0.025%
国債買入	4,000億円	1/21	応札	6,915億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	-0.007%	15.0%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	2,400億円	1/21	応札	4,608億円	落札	2,406億円	按分利回り較差	0.012%	64.4%	平均利回り較差	0.014%
国債買入	1,400億円	1/21	応札	3,822億円	落札	1,405億円	按分利回り較差	0.013%	44.3%	平均利回り較差	0.016%
J-REIT買入	12億円	約定日	1/19								

「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

<< 1/20の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,784,800	前日比	▲ 21,300
O/N	0.06~0.08	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.07~0.075%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 19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2,000億円増加の133兆7,000億円(当座預金残高見込みは180兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行から0.065~0.068%程度、地銀・信託業態から0.073~0.075%の調達希望が見える中、0.075%の出合いで始まった。一巡後は0.071~0.073%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関しては、ロール案件による出合いが散見された。

<< 19日のオープン市場動向 >>
現先レートは横ばい圏で推移した。短国市場は短国買入オペが30,000億円で開催され、平均利回り較差+0.025%、按分利回り較差+0.020%と売却ニーズの強さを反映した結果となった。オペ後は3M▲0.045~▲0.040%、1Y▲0.025%の出合いが見られる程度にとどまった。CP市場は入札件数・発行額共に少なく、総額770億円程度の出合いと閑散であった。

<< 20日の材料 >>
*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、21日まで)
*5年利付国債入札(27,000億円、1/22発行)
*交付税特別会計借入(10,500億円、1/29借入)

<<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)	117.58-61
0.205 ▲ 0.035	17,014.29 150.13	為替(5時)	117.16-18

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	1/9	1/13	1/14	1/15	1/16	1/19
日銀当預残	1,811,100	1,798,200	1,792,100	1,814,000	1,809,300	1,806,100
準備預金残	1,648,800	1,642,100	1,639,100	1,646,400	1,644,500	1,642,000
レート	0.075%	0.074%	0.073%	0.074%	0.074%	0.074%
月中平均	0.07100%	0.07123%	0.07136%	0.07153%	0.07194%	0.07205%

1/19の加重平均レート(速報)				1/16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)			O/N	0.060 ~0.135 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.075 ~0.125 (0.094)				T/N		0.074 ~0.125 (0.087)	
				S/N			
0.114 ~0.135 (0.123)				1W		0.065 ~0.260 (0.108)	
0.118 (0.118)				2W			
				3W			
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.170 (0.170)		有担先日付分
		0.08-0.12	0.0100	2M			
		0.08-0.12	▲0.045-▲0.040	3M			
		-	-	6M		0.145 (0.145)	
		-	▲0.025	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	30,000億円	1/21	応札	76,064億円	落札	30,000億円	按分利回り較差	0.020%	77.3%	平均利回り較差	0.025%
国債買入	4,000億円	1/21	応札	6,915億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	-0.007%	15.0%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	2,400億円	1/21	応札	4,608億円	落札	2,406億円	按分利回り較差	0.012%	64.4%	平均利回り較差	0.014%
国債買入	1,400億円	1/21	応札	3,822億円	落札	1,405億円	按分利回り較差	0.013%	44.3%	平均利回り較差	0.016%
J-REIT買入	12億円	約定日	1/19								

「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