

2015/1/20(火)

《セントラル短資株式会社》

《資金需給》

単位 億円

	20日需給速報	21日需給予想	22日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	1,500	300	▲ 1,000
財政	▲ 21,600	3,100	▲ 29,000
資金過不足	▲ 20,100	3,400	▲ 30,000
貸出			
売出手形			
0			
本店共通			
0			
全店共通			
0			
共通(固定)			
77,139			
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		8,500	
CP等買入			
	▲ 500	▲ 400	
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		100	
国債補充供給			
小計	▲ 500	39,200	0
当預増減	▲ 20,600	42,600	▲ 30,000

当座預金残高	1,785,500	1/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,614,100		192,100
積み終了先	1,277,500	1/21以降の残り所要積立額	
超過準備	1,259,100	積数	142,400
非準備先残高	171,400	1日平均	5,500
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	92.80% (実績)	16.13% (日数)	

1/19のマネタリーベース	2,744,000
1/19コール合計	206,965無担 83,919有担 123,046
コール前日増減 計	2,320無担 325有担 1,995

1/20 の加重平均レート(速報)				1/19 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 (0.077)	0.030 ～0.040 (0.031)			O/N	0.060 ～0.135 (0.074)	0.030 ～0.040 (0.031)		
0.074 ～0.125 (0.087)				T/N		0.075 ～0.125 (0.094)		
				S/N				
0.075 ～0.117 (0.095)				1W	0.114 ～0.135 (0.123)			
0.220 ～0.310 (0.238)				2W	0.118 (0.118)			
				3W				
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.118 ～0.200 (0.139)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	▲0.05	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.0275-▲0.025	1Y				

《オペ情報、入札結果》

CP買入 3,500億円 1/23 応札 11,499億円 落札 3,478億円 按分レート 0.092% 59.8% 平均落札レート 0.097%

5年利付国債(表面利率0.1%)応札10兆9,253億円落札2兆4,954億円(I 非競争入札:2,035億円) 1/22～2019/12/20 0.000%按分84.7609% 平均 0.000%

交付税特会 1兆500億円 1/29～7/30 応札 3兆4,700億円 落札 1兆500億円 0.090% 按分 61.9048% 平均 0.089%

「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

《 1/21の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,828,100	前日比	42,600
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。					

《 20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3兆2,000億円減少の130兆5,000億円(当座預金残高見込みは178兆5,000億円)。無担O/Nは地銀・信託・証券業態から0.073～0.075%前後の調達希望で始まった。一部業態より0.125%で少額の試し取りが行われたものの、一巡後は0.07～0.071%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程度であった。

《 20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。短国市場は全般的に閑散な中、3M ▲0.050%、1Y ▲0.0275～▲0.025%の出合いが見られた程度であった。CP市場は入札件数・発行額共に少なく、総額900億円程度の出合いにとどまった。発行レートは概ね横ばいであった。3,500億円で実施されたCP等買入オペは、足元金利の高止まりや特定銘柄の売却ニーズからか、平均レート0.097%、按分レート0.092%と、共に前回オペ比で上昇した。

《 21日の材料 》

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- *黒田日銀総裁、定例会見
- *経済・物価情勢の展望(中間評価)
- *11月の景気動向指数改訂状況
- *米国12月の住宅着工件数

《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)	117.74-76
0.215 0.010	17,366.30 352.01	為替(5時)	118.24-26

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	1/13	1/14	1/15	1/16	1/19	1/20
日銀当預残	1,798,200	1,792,100	1,814,000	1,809,300	1,806,100	1,785,500
準備預金残	1,642,100	1,639,100	1,646,400	1,644,500	1,642,200	1,614,100
レート	0.074%	0.073%	0.074%	0.074%	0.074%	0.077%
月中平均	0.07123%	0.07136%	0.07153%	0.07194%	0.07205%	0.07230%