

<<資金需給>>

単位 億円

	21日需給速報		22日需給予想		23日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		400	▲700	▲1,000		
財政		3,200	▲28,100	0		
資金過不足		3,600	▲28,800	▲1,000		
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				3,500		
貸出支援基金(成長)						
44,583(増加) 189,789						
被災地支援						0
3,251						0
社債等買入		1,000				
ETF買入		100				
国債補充供給						
小計		39,200	▲500	3,500		
当預増減		42,800	▲29,300	2,500		

当座預金残高	1,828,300	1/21以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,659,200		142,400
積み終了先	1,332,800	1/22以降の残り所要積立額	
超過準備	1,325,300	積数	113,900
非準備先残高	169,100	1日平均	4,600
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	94.24%	(実績)	19.35% (日数)

1/20のマナターベース		2,721,900	
1/20コール合計	200,127	無担	77,408
コール前日増減	▲6,838	無担	▲6,511
		有担	▲327

1/21の加重平均レート(速報)				1/20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	有担先日付分		
0.060 ~0.135 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.125 (0.077)			0.030 ~0.040 (0.031)		
0.055 ~0.120 (0.086)					0.074 ~0.125 (0.087)				
0.117 (0.117)					0.075 ~0.117 (0.095)				
0.340 (0.340)					0.220 ~0.310 (0.238)				
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-		0.118 (0.118)		有担先日付分		
0.120 (0.120)		0.08-0.12	-						
		0.08-0.12	▲0.06						
		-	-						
		-	▲0.025						

<<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 1/23~1/29 (6日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.620%

ETF買入 341億円 約定日 1/21

<日銀金融政策決定会合・結果>

・マナターベースが、年間約80兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(賛成8反対1)

・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)

- ① 長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。買入れの平均残存期間は7年~10年程度とする。
- ② ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約3兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
- ③ CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

・近期限の到来する「貸出増加を支援するための資金供給」、「成長基盤強化を支援するための資金供給」、「被災地金融機関を支援するための資金供給オペレーション」および「被災地企業等にかかる担保要件の緩和措置」について、以下のとおりとすることを決定した。(全員一致)

- ① 期限を1年間延長する。
- ② 「成長基盤強化支援」(本則)の対象金融機関毎の上限を1兆円から2兆円へ、総枠を7兆円から10兆円にそれぞれ引き上げる。
- ③ 「貸出増加支援」および「成長基盤強化支援」について、日本銀行の非取引先金融機関が各々の系統中央機関を通じて制度を利用し得る枠組みを導入する。

「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り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

1/22の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,799,000	前日比	▲29,300
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%程度での出会いが中心になると見込まれる。					

<< 21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4兆8,000億円増加の135兆3,000億円(当座預金残高見込みは182兆8,000億円)。無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.072~0.075%前後の調達希望で始まり、0.075%の出会いで立ち上がった。昨日より調達意欲は弱く、一巡後は0.065~0.068%を中心とした出会いで推移し、本日の取引を終了した。また、引き続き一部業態より0.125%で少額の試し取りが行われた。ターム物に関してはロール案件による出会いが散見された程度であった。金融政策決定会合では、金融政策の現状維持と貸出支援制度の延長・拡充が決定された。

<< 21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。短国市場は全般的に閑散な中、3Mが▲0.060%、1Yが▲0.025%の出会いが見られた程度であった。CP市場は25日にかかる発行となったことで、鉄鋼・電機業態でまとまった発行が見られ、発行総額は2,200億円程度に膨らんだ。発行レートは足元金利の高止まりや、昨日のCP等買入オペの結果を受け、全体的に小幅上昇した。

<< 22日の材料 >>

- *日銀金融経済月報
- *ECB定例理事会(金融政策発表)
- *国庫短期証券入札(3ヵ月、57,000億円、1/26発行)
- *20年利付国債入札(12,000億円、1/26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	0.245	0.030	日経平均株価(終値)	17,280.48	▲85.82	為替(9時)	118.64-66
						為替(5時)	117.65-67

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	1/14	1/15	1/16	1/19	1/20	1/21
日銀当預残	1,792,100	1,814,000	1,809,300	1,806,100	1,785,500	1,828,300
準備預金残	1,639,100	1,646,400	1,644,500	1,642,200	1,615,600	1,659,200
レート	0.073%	0.074%	0.074%	0.074%	0.077%	0.074%
月中平均	0.07136%	0.07153%	0.07194%	0.07205%	0.07230%	0.07238%