

<<資金需給>>

単位 億円

	22日需給速報		23日需給予想	26日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 800	▲ 800	2,000
財政		▲ 29,200	1,300	▲ 20,000
資金過不足		▲ 30,000	500	▲ 18,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,900
77,139				▲ 4,100
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				
CP等買入		▲ 500	3,500	▲ 500
貸出支援基金(成長) 44,583(増加) 189,789				
被災地支援			0	0
3,251			0	0
社債等買入			▲ 200	
ETF買入			300	
国債補完供給				
小計		▲ 500	3,100	▲ 1,200
当増減		▲ 30,500	3,600	▲ 19,200

当座預金残高	1,797,800	1/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,628,200		113,900
積み終了先	1,311,700	1/23以降の残り所要積立額	
超過準備	1,306,400	積数	96,800
非準備先残高	169,600	1日平均	4,000
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	95.11%	(実績)	22.58% (日数)

1/21のマナタリーベース		2,764,300	
1/21コール	合計	197,027	無担 75,585 有担 121,442
コール前日増減	計	▲ 3,100	無担 ▲ 1,823 有担 ▲ 1,277

1/22の加重平均レート(速報)				1/21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
0.060 ~ 0.125 (0.075)	0.030 ~ 0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~ 0.135 (0.074)			0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.075 ~ 0.120 (0.085)				T/N		0.055 ~ 0.120 (0.086)		
0.125 ~ 0.200 (0.163)				S/N				
0.088 ~ 0.117 (0.094)				1W		0.117 (0.117)		
				2W		0.340 (0.340)		
				3W				
0.118 ~ 0.145 (0.136)		0.08-0.12	-	1M		0.118 (0.118)		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		0.120 (0.120)		
		0.08-0.12	▲0.009-▲0.001	3M				
		-	▲0.035	6M				
		-	▲0.023	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	1/26 ~ 4/27 (91日間)	応札 2,911億円	落札 2,911億円	0.100%	全取	平均 0.100% (固定)
国債補完	2,000億円	1/22 ~ 1/23 (1日間)	応札 21億円	落札 21億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
T-Bill3M	応札41兆9,276億7,000万円	落札5兆3,132億4,000万円(非競争入札:4,167億円)	1/26~4/27	▲0.0020%	按分29.5237%	平均▲0.0048%	
20年利付国債(表面利率1.2%)	応札3兆5,684億円	落札1兆951億円(I非競争入札:1,041億円)	1/26~2034/12/20	0.912%	按分83.0812%	平均0.905%	
ETF買入	341億円	約定日 1/22					
J-REIT買入	12億円	約定日 1/22					

<< 1/23の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,801,400	前日比	3,600
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。

<< 22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2兆8,000億円減少の132兆5,000億円(当座預金残高見込みは179兆9,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは、地銀・信託・証券業態から0.68~0.070%の調達希望と前日より低下していたが、大手行から0.068%で調達希望が見られたため、0.07~0.072%前後の出合いが始まった。取り急ぐ動きはみられず、一巡後も0.07~0.072%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。3M物の共通担保オペが8,000億円オファーされ、結果は落札総額2,911億円(期日分:4,071億円)と札割れになった。

<< 22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3M物の入札が実施された。結果は平均落札利回▲0.0048%、最高落札利回▲0.0020%と引続き堅調であった。セカンダリーは▲0.008~▲0.001%で推移した。CP市場は26日にかかる発行となり、鉄鋼・建設業態でまとまった発行も見られたことで、発行総額は3,500億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいでの推移となった。

<< 23日の材料 >>

- *岩田日銀副総裁、ADBI・OECD・日本 ハイレベル・グローバル・シンポジウムにて講演
- *月例経済報告
- *米国2月の中古住宅販売

JGB新発10年債	0.325	0.080	日経平均株価(終値)	17,329.02	48.54	為替(9時)	117.84-87
						為替(5時)	117.99-00

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	1/15	1/16	1/19	1/20	1/21	1/22
日銀当預残	1,814,000	1,809,300	1,806,100	1,785,500	1,828,300	1,797,800
準備預金残	1,646,400	1,644,500	1,642,200	1,615,600	1,660,200	1,628,200
レート	0.074%	0.074%	0.074%	0.077%	0.074%	0.075%
月中平均	0.07153%	0.07194%	0.07205%	0.07230%	0.07238%	0.07250%

「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する書面や目録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