

<<資金需給>>

単位 億円

	26日需給速報		27日需給予想	28日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		700	600	0
財政		▲ 19,900	7,700	▲ 1,000
資金過不足		▲ 19,200	8,300	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,900		
75,979		▲ 4,100		
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			12,300	4,200
CP等買入				
		▲ 1,000	▲ 100	
貸出支援基金				
(成長) 44,583				
(増加) 189,789				
被災地支援				
3,252				
社債等買入				
ETF買入		300		
国債補完供給		100		
小計		▲ 1,800	42,200	4,200
当預増減		▲ 21,000	50,500	3,200

当座預金残高	1,782,100	1/26以降の残り所要積立額
準備預金残高	1,614,500	65,800
積み終了先	1,299,800	1/27以降の残り所要積立額
超過準備	1,299,700	積数
非準備先残高	167,600	1日平均
		3,000
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	97.00% (実績)	35.48% (日数)

1/23のマナリーベース		2,740,700	
1/23コール	合計	195,569	無担 76,615 有担 118,954
コール前日増減	計	▲ 734	無担 749 有担 ▲ 1,483

1/26の加重平均レート(速報)				1/23の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		CP気配a-1	短国	単位(%)	
0.060 ~0.125 (0.071)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.060 ~0.080 (0.073)
0.073 ~0.120 (0.083)						T/N	0.074 ~0.120 (0.089)
0.125 (0.125)						S/N	
0.117 ~0.119 (0.118)						1W	0.117 (0.117) 0.069 ~0.260 (0.119)
0.118 ~0.310 (0.132)						2W	0.115 ~0.118 (0.118)
0.118 (0.118)						3W	0.118 (0.118)
				0.08-0.12	-	1M	0.115 (0.115)
				0.08-0.12	-	2M	
				0.08-0.12	▲0.001	3M	
				-	-	6M	
				-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	4,000億円	1/28	応札	12,006億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	-0.025%	99.0%	平均利回り較差	-0.020%
国債買入	200億円	1/28	応札	987億円	落札	201億円	按分価格較差	-0.360円	64.9%	平均価格較差	-0.385円
ETF買入	341億円	約定日	1/26								
J-REIT買入	12億円	約定日	1/26								

<< 1/27の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,832,600	前日比	50,500
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。

<< 26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1兆5,000億円減少の13兆7,000億円(当座預金残高見込みは17兆8,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは、大手行から0.068%の調達希望で始まり、地銀・信託業態を中心に0.071%前後の出合いが見られた。一巡後は調達側が薄くなる中、0.069~0.071%の水準で出合いが散見された。ターム物に関しては、大手行から1W物は0.117%、2W物は0.118%で調達が行われた。

<< 26日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは、概ね横ばい圏で推移した。短国市場は、3M▲0.001%で出合いが見られたものの、全体的に閑散としていた。CP市場は、商社・鉄鋼業態を中心に総額1,000億円程度の発行が実施された。発行レートは、現先レートの高止まりの影響から、若干小高い水準が続いていた。

<< 27日の材料 >>  
 \*12月の企業向けサービス価格指数  
 \*米国FOMC(1日目)  
 \*米国12月の新築一戸建て販売件数  
 \*米国11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数  
 \*米国12月の耐久財新規受注 \*米国1月のCB消費者信頼感指数  
 \*英国10-12月期のGDP速報値  
 \*流動性供給入札(4,000億円、1/29発行)  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、2/4借入)

JGB新発10年債	0.225	▲ 0.025	日経平均株価(終値)	17,468.52	▲ 43.23	為替(9時)	117.41-43
						為替(5時)	118.16-19

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	1/19	1/20	1/21	1/22	1/23	1/26
日銀当預残	1,806,100	1,785,500	1,828,300	1,797,800	1,803,100	1,782,100
準備預金残	1,642,200	1,615,600	1,660,200	1,630,000	1,630,500	1,614,500
レート	0.074%	0.077%	0.074%	0.075%	0.073%	0.071%
月中平均	0.07205%	0.07230%	0.07238%	0.07250%	0.07256%	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し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