

《資金需給》

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想	6日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		6,200	6,200	7,000
財政		▲ 500	▲ 5,600	▲ 25,000
資金過不足		5,700	600	▲ 18,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		1,300		
63,515		▲ 1,500		
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			11,100	5,100
CP等買入				
		▲ 300	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 271,714				
被災地支援				
3,143				
社債等買入				
ETF買入				
国債補充供給				
小計		▲ 500	10,800	5,100
当預増減		5,200	11,400	▲ 12,900

1/5の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,546,800	前日比	11,400
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07~0.08%程度での出合いが中心になると見込まれる。

《 4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7,000億円増の187兆3,000億円(当座預金残高見込みは253兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態を中心に0.07%近辺の調達希望で始まった。年末要因が剥落したものの、先週のレート水準まで戻すには至らず、まとまった金額に対しては0.075%程度での出合いも散見されたが、一巡後も0.07%前後を中心に散発的に出合う程度で本日の取引を終了した。ターム物は、大手行から3W物の0.118%でまとまった調達が見られた。

《 4日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国市場はカレンダーベースで期を越えたものの特段出合いは見られず、様子見閑散となった。CP市場は鉄鋼業態から大型発行案件が見られたものの、年始ということもあり発行総額は900億円程度と閑散であった。発行レートは昨年末の地合いを引き継ぎ、一般的に上昇基調となった。

《 5日の材料 》

- *12月のマネタリーベース
- *12月実績/1月見込み財政資金対民間取支
- *ユーロ圏12月の消費者物価指数速報値
- *10年利付国債入札(24,000億円、1/7発行)

《コール12月の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	0.07368%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07486%	有担 0.03100%

当座預金残高	2,535,400	1/4以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,312,000		400
積み終了先	1,865,100	1/5以降の残り所要積立額	
超過準備	1,865,100	積数	300
非準備先残高	223,400	1日平均	0
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)	2,042,000		
準備預金進捗率	99.99% (実績)	64.52%	(日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.30-33
0.260 ▲ 0.005	18,450.98 ▲ 582.73	為替(5時)	118.97-99

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	12/24	12/25	12/28	12/29	12/30	1/4
日銀当預残	2,536,100	2,535,000	2,531,200	2,527,400	2,530,200	2,535,400
準備預金残	2,302,600	2,313,600	2,312,200	2,308,200	2,306,900	2,312,000
レート	0.086%	0.073%	0.073%	0.073%	0.038%	0.070%
月中平均	0.07679%	0.07637%	0.07625%	0.07614%	0.07368%	0.04600%

12/30のマネタリーベース			
12/30コール合計	193,319	無担	56,487
有担	136,832		
コール前日増減	▲ 7,086	無担	▲ 13,349
有担	6,263		

1/4の加重平均レート(速報)				12/30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		有担当日分
0.030 ~0.125 (0.070)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.004 ~0.079 (0.038)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.060 ~0.130 (0.079)						T/N		0.073 ~0.121 (0.099)
						S/N		
0.117 ~0.130 (0.121)						1W	0.155	(0.155)
0.117 ~0.310 (0.133)						2W		
0.118 (0.118)						3W		
0.165 ~0.630 (0.191)				0.07-0.12	-	1M	0.116	(0.116)
				0.07-0.11	-	2M		
				0.07-0.11	-	3M		
				-	-	6M		
				-	-	1Y		

《オペ情報、入札結果》

国債買入	700億円	1/6	応札	4,127億円	落札	700億円	全取利回り較差	0.037%	平均利回り較差	0.037%	
国債買入	2,600億円	1/6	応札	7,786億円	落札	2,606億円	按分利回り較差	-0.007%	19.9%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	1,800億円	1/6	応札	6,648億円	落札	1,805億円	按分利回り較差	0.002%	37.0%	平均利回り較差	0.004%
ETF買入	369億円	約定日	1/4								
J-REIT買入	12億円	約定日	1/4								

「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

あけましておめでとうございます。本年もよろしくお願い申し上げます。