

**《資金需給》**

単位 億円

	8日需給速報		12日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		2,100	3,400	4,000
財政		100	▲ 13,100	▲ 25,000
資金過不足		2,200	▲ 9,700	▲ 21,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			800	
63,515			▲ 600	
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		12,900		8,900
CP等買入		▲ 500	▲ 100	3,000
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		200	200	
国債補完供給				
小計		12,600	300	11,900
当預増減		14,800	▲ 9,400	▲ 9,100

当座預金残高	2,534,900	1/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,328,800		200
積み終了先	1,886,000	1/12以降の残り所要積立額	
超過準備	1,886,000	積数	100
非準預先残高	206,100	1日平均	0
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)	2,053,000		
準備預金進捗率	100.00% (実績)	87.10%	(日数)

1/7のマナタリーベース		3,531,100	
1/7コール 合計	231,176 無担	89,051 有担	142,125
コール前日増減 計	1,418 無担	6,936 有担	▲ 5,518

1/8の加重平均レート(速報)				1/7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
0.050 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)					O/N	0.060 ~0.125 (0.075)	0.072 ~0.130 (0.085)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.070 ~0.125 (0.086)						T/N			
						S/N			
0.125 ~0.150 (0.135)						1W		0.117 ~0.340 (0.121)	
0.118 ~0.150 (0.131)						2W		0.073 ~0.340 (0.116)	
0.140 (0.140)						3W		0.118 (0.118)	
				0.07-0.12	-	1M		0.150 ~0.155 (0.153)	有担先日付分
				0.07-0.11	-	2M		0.130 (0.130)	
				0.07-0.11	▲0.03-▲0.02	3M			
				-	▲0.155-▲0.08	6M			
				-	-	1Y			

**《オペ情報、入札結果》**

国債買入	4,500億円	1/13	応札	11,497億円	落札	4,506億円	按分利回り較差	-0.004%	8.2%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	2,600億円	1/13	応札	5,407億円	落札	2,607億円	按分利回り較差	-0.002%	83.2%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	1,800億円	1/13	応札	4,311億円	落札	1,807億円	按分利回り較差	0.001%	93.8%	平均利回り較差	0.004%
T-Bill6M	応札1兆5,496億円	落札3兆2,192億6,000万円(非競争入札:2,807億円)	1/13~7/11	▲0.0425%	按分26.7418%	平均▲0.0608%					
J-REIT買入	12億円	約定日	1/8								

1/12の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,525,500	前日比	▲ 9,400
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。

**《 8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2兆6,000億円増の188兆4,000億円(当座預金残高見込みは253兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態を中心に0.078%のまとまった金額の調達希望で始まり、一部では0.079%での出合いも散見された。午後は0.075%前後まで調達レートは低下し、本日の取引を終了した。ターム物は、大手行から2W物0.118%で調達が見られた。

**《 8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6M物の入札が実施された。W I取引で少額ながら▲0.08%が出合うなど過熱感の強い中、平均落札利回り▲0.0608%、按分落札利回り▲0.0425%と平均・按分ともに6M物では過去最低レートを更新する強い入札となった。セカンダリーは▲0.085%から▲0.155%まで買い進まれた。その他、3M物では▲0.03~▲0.02%の出合いが見られた。CP市場は発行件数が少なく、発行総額は400億円強程度と閑散だった。発行レートは地合いを引き継ぎ、高めでの決着となった。

**《 11日の材料 》**

\*米国12月のFRB労働市場情勢指数

**《 12日の材料 》**

\*11月の国際収支  
\*12月の消費動向調査  
\*12月の景気ウォッチャー調査

JGB新発10年債	0.225	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	17,697.96	▲ 69.38	為替(9時)	117.52-54
						為替(5時)	118.23-25

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	12/30	1/4	1/5	1/6	1/7	1/8
日銀当預残	2,530,200	2,535,400	2,549,000	2,538,800	2,520,100	2,534,900
準備預金残	2,306,900	2,312,300	2,325,800	2,316,300	2,313,200	2,328,800
レート	0.038%	0.070%	0.074%	0.075%	0.075%	0.077%
月中平均	0.07368%	0.04600%	0.05160%	0.05550%	0.05829%	0.06509%

「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