

<<資金需給>>

単位 億円

	12日需給速報		13日需給予想	14日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		3,700	3,400	3,000
財政		▲ 12,800	▲ 24,700	▲ 17,000
資金過不足		▲ 9,100	▲ 21,300	▲ 14,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		800		
63,715		▲ 600		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				25,000
国庫短期証売却				
国債買入			9,500	8,900
CP等買入			3,000	
		▲ 100	▲ 200	
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		
国債補充供給				
小計		300	12,300	33,900
当預増減		▲ 8,800	▲ 9,000	19,900

<< 1/13の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,517,100	前日比	▲ 9,000
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。					

<< 12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3,000億円減の188兆1,000億円(当座預金残高見込みは252兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、やや強含みが見られた先週末から落ち着きを取り戻し、大手行・地銀・信託業態を中心に0.073~0.074%近辺の調達希望で始まった。まとまった金額に対しては0.075~0.076%程度での出合いも一部でみられた。一巡後は調達レートが低下し、0.07~0.075%程度の出合いが散見される中で本日の取引を終えた。ターム物については、出合いは閑散であった。

<< 12日のオープン市場動向 >>

短国現先レートS/Nは前日から小幅低下した。短国買入オペが2兆5,000億円通知された。オペ待ち玉となっていた6M物や1Y物を中心に応札されたと見られ、按分利回較差+0.024%、平均利回較差+0.028%、按分比率74.8%という結果になった。アウトライト市場は、3M物で▲0.03%の出合いが見られたが、全体としては閑散だった。CP市場は償還総額300億円程度に対し、発行総額は1,000億円程度。商社、小売、建設業態からのまとまった発行案件が見られた。前週からの流れを引き継ぎ、発行レートはやや高めとの印象だった。

<< 13日の材料 >>

- \*12月のマネーストック
- \*米国ページブック
- \*米国12月の財政収支
- \*10年物価連動国債(5,000億円、1/15発行)

当座預金残高	2,526,100	1/12以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,324,400		100
積み終了先	1,880,100	1/13以降の残り所要積立額	
超過準備	1,880,100	積数	0
非準備先残高	201,700	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)		90.32% (日数)

JGB新発10年債	0.215	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,218.96	▲ 479.00	為替(9時)	117.68-70
						為替(5時)	117.39-40

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	1/4	1/5	1/6	1/7	1/8	1/12
日銀当預残	2,535,400	2,549,000	2,538,800	2,520,100	2,534,900	2,526,100
準備預金残	2,312,300	2,325,800	2,316,300	2,313,200	2,328,800	2,324,400
レート	0.070%	0.074%	0.075%	0.075%	0.077%	0.075%
月中平均	0.04600%	0.05160%	0.05550%	0.05829%	0.06509%	0.06592%

1/8のマネタリーベース		3,543,900	
1/8コール合計	232,172	無担	91,810
		有担	140,362
コール前日増減	計	996	無担
		2,759	有担
			▲ 1,763

1/12の加重平均レート(速報)				1/8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
0.060 ~0.125 (0.075)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.050 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.070 ~0.120 (0.079)						T/N		0.070 ~0.125 (0.086)	
						S/N			
0.130 (0.130)						1W	0.125 (0.125)	0.150 (0.150)	
0.114 ~0.310 (0.132)						2W		0.118 ~0.150 (0.125)	
0.155 (0.155)						3W		0.140 (0.140)	
				0.07-0.12	-	1M			有担先日付分
				0.07-0.11	-	2M			
				0.07-0.11	▲0.03	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,000億円	1/12	~ 1/13 (1日間) 応札	14億円	落札	14億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	25,000億円	1/14	応札	55,495億円	落札	25,000億円	0.024%	74.8%	平均利回り較差	0.028%
国債買入	700億円	1/14	応札	3,271億円	落札	701億円	0.038%	33.8%	平均利回り較差	0.100%
国債買入	4,000億円	1/14	応札	11,438億円	落札	4,001億円	0.015%	60.3%	平均利回り較差	0.015%
国債買入	4,200億円	1/14	応札	13,755億円	落札	4,208億円	0.001%	39.6%	平均利回り較差	0.002%
米ドル資金供給(固定金利方式)		1/14~1/22 (8日間)	応札なし						貸付利率	0.850%
ETF買入	352億円	約定日	1/12							
J-REIT買入	12億円	約定日	1/12							

「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