

《資金需給》

単位 億円

	14日需給速報		15日需給予想		18日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		2,100		1,600		2,000
財政		▲ 12,300		▲ 10,000		1,000
資金過不足		▲ 10,200		▲ 8,400		3,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					1,300	
63,715					▲ 2,000	
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		8,900			12,700	
CP等買入						
		▲ 200		▲ 800		
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		300		300		
国債補完供給						
小計		34,000		▲ 500	12,000	
当預増減		23,800		▲ 8,900	15,000	

1/15の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,531,400	前日比	▲ 8,900
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。

《 14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2兆円増の189兆4,000億円(当座預金残高見込みは254兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態を中心に0.074~0.075%近辺の調達希望で始まり、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、0.07~0.074%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、出合いは閑散であった。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1,340億円(期落ち分1,980億円)となった。

《 14日のオープン市場動向 》
 短国現先レートS/Nは前日から横ばい圏で推移した。短国3M物の入札は、WI取引で▲0.03%の出合いが見られる中、按分落札レート▲0.0220%(按分比率16.5171%)、平均落札レート▲0.0276%と、堅調な結果となった。セカンダリーでは▲0.025~▲0.022%の出合いが見られた。CP市場は償還総額400億円程度に対して、発行総額900億円程度。商社、電機業態等からのまとまった発行案件が見られた。現先レートが高止まりしていたことで、引き続き発行レートは高めとの印象であった。

- 《 15日の材料 》**
- *11月のマネタリーサーベイ
 - *米国11月の企業在庫
 - *米国12月の生産者物価指数
 - *米国12月の小売売上高
 - *米国12月の鉱工業生産・設備稼働率
 - *米国1月のミシガン大消費者信頼感指数速報
 - *流動性供給入札(3,000億円、1/19発行)

当座預金残高	2,540,300	1/14以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	2,338,400	1/15以降の残り所要積立額	0
積み終了先	1,895,500	積数	0
超過準備	1,895,500	1日平均	0
非準備預先残高	201,900	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)		96.77% (日数)

JGB新発10年債	0.225	0.020	日経平均株価(終値)	17,240.95	▲ 474.68	為替(9時)	117.41-43
						為替(5時)	118.09-11

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	1/6	1/7	1/8	1/12	1/13	1/14
日銀当預残	2,538,800	2,520,100	2,534,900	2,526,100	2,516,500	2,540,300
準備預金残	2,316,300	2,313,200	2,328,800	2,324,500	2,318,500	2,338,400
レート	0.075%	0.075%	0.077%	0.075%	0.075%	0.075%
月中平均	0.05550%	0.05829%	0.06509%	0.06592%	0.06662%	0.06721%

1/13のマネタリーベース			3,518,300			
1/13コール	合計	235,476	無担	94,129	有担	141,347
コール前日増減	計	5,141	無担	1,662	有担	3,479

1/14の加重平均レート(速報)				1/13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	
0.060 ~ 0.125 (0.075)	0.030 ~ 0.040 (0.031)					O/N	0.060 ~ 0.125 (0.075)		0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.070 ~ 0.121 (0.080)				T/N			0.070 ~ 0.120 (0.078)		
				S/N					
0.130 (0.130)				1W			0.114 (0.114)		
0.160 (0.160)				2W					
				3W			0.155 (0.155)		
				1M	0.07~0.12	-	0.080 ~ 0.155 (0.132)		有担先日付分
				2M	0.07~0.11	-			
				3M	0.07~0.11	▲0.03-▲0.022			
				6M	-	-			
				1Y	-	-			

《オペ情報、入札結果》

全店共通	8,000億円	1/18	~	4/18 (91日間)	応札	1,340億円	落札	1,340億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	8,000億円	1/14	~	1/15 (1日間)	応札	12億円	落札	12億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	4,000億円	1/18	応札	14,590億円	落札	4,000億円	全取	利回り較差	0.020%		平均	利回り較差	0.020%
国債買入	4,200億円	1/18	応札	13,010億円	落札	4,207億円	全取	利回り較差	0.000%	74.0%	平均	利回り較差	0.001%
国債買入	4,500億円	1/18	応札	13,333億円	落札	4,510億円	全取	利回り較差	-0.005%	31.9%	平均	利回り較差	-0.004%
T-Bill3M	応札19兆2,575億円	落札4兆856億5,000万円(非競争入札:3,843億円)	1/18~4/18	▲0.0220%	按分	16.5171%	平均	▲0.0276%					
交付税特会	1兆500億円	1/22~7/22	応札	3兆5,090億円	落札	1兆500億円	0.086%	按分	22.0000%	平均	0.082%		
ETF買入	352億円	約定日	1/14										
J-REIT買入	12億円	約定日	1/14										

「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