

<<資金需給>>

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想	21日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		2,100	800	▲ 1,000
財政		2,900	▲ 12,700	▲ 27,000
資金過不足		5,000	▲ 11,900	▲ 28,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		6,200		
65,875		▲ 3,400		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		15,000		
国庫短期証売却				
国債買入			9,400	
CP等買入				3,000
		▲ 300	▲ 500	
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		1,000		
ETF買入		200	200	
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		18,600	9,200	3,000
当預増減		23,600	▲ 2,700	▲ 25,000

<< 1/20の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,562,000	前日比	▲ 2,700
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。

<< 19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2兆4,000億円増加の19兆5,000億円(当座預金残高見込みは25兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.073%近辺、地銀・信託業態から0.073~0.075%近辺の調達希望。前日とはほぼ変わらない立ち上がりで、朝方は0.074~0.075%近辺の出合いが中心。一巡後は0.07~0.075%のレンジで推移した。一部では試し取りによる0.12%近辺の出合いが見受けられた。ターム物は、証券業態によるロール案件の調達が散見された。

<< 19日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは低位横ばい圏で推移した。短国市場は材料なく閑散とした地合いの中、3M物で▲0.018%、1Y物で▲0.10%の出合いがみられた程度であった。CP市場は商社業態からまとまった発行案件がみられたものの、全体の発行総額は500億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

<< 20日の材料 >>
 *月例経済報告
 *米国12月の消費者物価指数
 *米国12月の住宅着工件数
 *交付税特別会計借入(10,500億円、1/28借入)

<<コール12月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06955%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07384%	有担 0.03100%

当座預金残高	2,564,700	1/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,360,300		190,300
積み終了先	1,878,800	1/20以降の残り所要積立額	
超過準備	1,867,100	積数	140,900
非準備先残高	204,400	1日平均	5,200
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	2,057,100		
準備預金進捗率	93.15% (実績)	12.90% (日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	117.38-41
0.210 0.010	17,048.37 92.80	為替(5時)	117.90-91

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	1/12	1/13	1/14	1/15	1/18	1/19
日銀当預残	2,526,100	2,516,500	2,540,300	2,529,800	2,541,100	2,564,700
準備預金残	2,324,500	2,318,500	2,338,700	2,323,600	2,330,600	2,360,300
レート	0.075%	0.075%	0.075%	0.075%	0.074%	0.076%
月中平均	0.06592%	0.06662%	0.06721%	0.06859%	0.06889%	0.06926%

1/18のマネタリーベース			3,537,100			
1/18コール	合計	232,262	無担	93,501	有担	138,761
コール前日増減	計	▲ 2,125	無担	3,419	有担	▲ 5,544

1/19の加重平均レート(速報)				1/18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	有担先日付分	
0.030 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.125 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.070 ~0.125 (0.088)				T/N	0.072 ~0.121 (0.082)			
				S/N				
0.114 ~0.130 (0.119)				1W	0.114 ~0.150 (0.128)			
0.065 ~0.160 (0.123)				2W	0.114 ~0.310 (0.138)			
				3W				
0.280 (0.280)		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
		0.07-0.11	▲0.018	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.10	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 4,000億円 1/19 ~ 1/20 (1日間) 応札 50億円 落札 50億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 5年利付国債(表面利率0.1%) 応札9兆2,983億円 落札2兆2,699億円 (I非競争入札:2,295億円) 1/21~2020/12/20 0.018% 按分29.1287% 平均0.016%
 ETF買入 352億円 約定日 1/19
 J-REIT買入 12億円 約定日 1/19

「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