

<<資金需給>>

単位 億円

	28日需給速報		29日需給予想	1日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 800	▲ 200	2,000
財政		▲ 3,800	▲ 1,700	1,000
資金過不足		▲ 4,600	▲ 1,900	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				400
62,714				▲ 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			13,300	
CP等買入			3,500	
		▲ 300	▲ 3,600	
貸出支援基金				
(成長) 58,484				
(増加) 271,714				
被災地支援				
3,144				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入		300	300	
国債補完供給		100		
小計		0	13,500	▲ 100
当預増減		▲ 4,600	11,600	2,900

<< 1/29の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,594,400	前日比	11,600
O/N	0.05~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.05~0.08%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 28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6,000億円減少の192兆7,000億円(当座預金残高見込みは258兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.073%、地銀・信託業態から0.073~0.075%近辺の調達希望。朝方は0.075%近辺の出合いが中心。一巡後は0.07~0.075%のレンジでの出合いが見られた。ターム物では、1W物で大手行によるまとまった調達が見られた。本日の共通担保資金供給オペは、3M物8,000億円のオファーに対し、応札額375億円(期落ち分525億円)の札割れとなった。

<< 28日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばい圏で推移。短国市場は3M物の入札が実施された。W I取引で▲0.05%と強めの出合いが見られていたが、入札結果は平均落札利回り▲0.0356%・按分落札利回り▲0.030%と、概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリー市場は調整売りから▲0.03%の出合いが見られた。CP市場は幅広い業態から大型の発行案件が見られ、発行総額は2,800億円程度まで膨らんだ。発行レートは引続き横ばい圏での動きとなった。

- << 29日の材料 >>
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
 *黒田日銀総裁定例会見 *経済・物価情勢の展望
 *12月の完全失業率(市場予想: 3.3%) *12月の住宅着工統計
 *12月の有効求人倍率(市場予想: 1.26倍)
 *12月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比▲2.4%)
 *12月全国・1月都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想: 全 国(12月)前年同月比(除く生鮮): +0.1%
 東京都区部(1月)前年同月比(除く生鮮): +0.1%
 *12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想: 前月比▲0.3%)
 *米国10-12月期のGDP速報値 *米国1月のシカゴPM景況感指数
 *ユーロ圏1月の消費者物価指数速報値

当座預金残高	2,582,800	1/28以降の残り所要積立額	41,500
準備預金残高	2,369,500	1/29以降の残り所要積立額	35,500
積み終了先	1,920,800	積数	2,000
超過準備	1,920,500	1日平均	2,000
非準備先残高	213,300		
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	2,055,700		
準備預金進捗率	98.27% (実績)	41.94% (日数)	

JGB新発10年債	0.220	0.010	日経平均株価(終値)	17,041.45	▲ 122.47	為替(9時)	118.47-49
						為替(5時)	118.78-80

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	1/21	1/22	1/25	1/26	1/27	1/28
日銀当預残	2,538,100	2,546,400	2,543,500	2,583,100	2,587,400	2,582,800
準備預金残	2,327,100	2,333,000	2,328,500	2,364,400	2,377,200	2,369,500
レート	0.075%	0.075%	0.075%	0.079%	0.076%	0.074%
月中平均	0.06976%	0.07042%	0.07060%	0.07092%	0.07111%	0.07121%

1/27のマナターベース			3,581,100			
1/27コール	合計	229,687	無担	87,718	有担	141,969
コール前日増減	計	▲ 1,978	無担	105	有担	▲ 2,083

1/28の加重平均レート(速報)			
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国
0.060 ~0.125 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)		
0.050 ~0.121 (0.077)			
0.096 ~0.130 (0.117)			
0.145 (0.145)			
0.117 ~0.118 (0.117)		0.07-0.12	-
		0.07-0.11	-
		0.07-0.11	▲0.05-▲0.03
		-	-
		-	-

1/27の加重平均レート(確報)			単位(%)
無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
	0.073 ~0.130 (0.084)		
	0.030 (0.030)		
	0.097 ~0.130 (0.112)		
		有担先日付分	

<<オペ情報、入札結果>>
 全店共通 8,000億円 2/1 ~ 5/2 (91日間) 応札 375億円 落札 375億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札17兆6,325億円 落札4兆1,620億5,000万円(非競争入札:3,579億円) 2/1~5/2 ▲0.0300% 按分80.0082% 平均▲0.0356%
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札11兆522億円 落札2兆2,827億円(I非競争入札:2,162億円) 2/15~2018/2/15 ▲0.014% 按分34.5650% 平均▲0.018%
 交付税特会 1兆500億円 2/9~8/9 応札 2兆8,468億円 落札1兆500億100万円 0.076% 按分77.4650% 平均0.075%
 J-REIT買入 12億円 約定日 1/28

「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