

<<資金需給>>

単位 億円

	6日需給速報		7日需給予想		8日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		7,700	7,100	6,000		
財政		▲ 4,100	▲ 2,300	▲ 21,000		
資金過不足		3,600	4,800	▲ 15,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		3,200		3,300		
177,496		▲ 6,700		▲ 4,300		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入		20,000				
国庫短期証売却						
国債買入		6,000	6,400	7,000		
CP等買入						
		▲ 200	▲ 300			
貸出支援基金						
(成長) 34,599						
(増加) 50,859						
被災地支援						
3,804						
社債等買入						
ETF買入		200	200			
国債補完供給						
小計		22,500	6,300	6,000		
当預増減		26,100	11,100	▲ 9,000		

<< 1/7の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,108,000	前日比	11,100
O/N	0.06~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07%前後の出合いが中心となるであろう。

<< 6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は、前営業日比2兆6,000億円増の85兆4,000億円(当座預金残高見込は109兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、信託業態・地銀業態からは0.07%前後での調達希望、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。年末要因が剥落した事でビッドが回復し、終日0.07%前後の落ち着いた取引となった。ターム物は、大手行から1M0.118%でまとまった調達が見られた。

<< 6日のオープン市場動向 >>
 現先レートは低位横ばいで推移。短国市場は3M0.055%で少額の出合いが見られた程度で全般的に動意なく閑散。CP市場は、鉄鋼、電機業態によるまとまった発行がみられたことで、総額1,500億円程度の発行。発行レートは概ね横ばいで推移。

- << 7日の材料 >>
- *12月のマネタリーベース
 - *12月実績/1月見込み財政資金対民間収支
 - *米国11月の貿易収支
 - *ユーロ圏12月の消費者物価指数速報値
 - *国庫短期証券入札(3カ月、57,000億円、1/9発行)
 - *10年利付国債入札(24,000億円、1/9発行)

<<コール12月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07313%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07370%	有担 0.04100%

当座預金残高	1,096,900	1/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	985,500		20,800
積み終了先	843,000	1/7以降の残り所要積立額	
超過準備	843,000	積数	18,400
非準備先残高	111,400	1日平均	2,000
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			1,860,200
準備預金進捗率	99.01%	(実績)	70.97% (日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	104.91-92
0.725 ▲ 0.010	15,908.88 ▲ 382.43	為替(5時)	104.37-38

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	12/24	12/25	12/26	12/27	12/30	1/6
日銀当預残	1,050,600	1,064,900	1,064,100	1,063,600	1,070,800	1,096,900
準備預金残	955,300	966,500	962,400	960,900	969,600	985,500
レート	0.073%	0.072%	0.072%	0.073%	0.068%	0.072%
月中平均	0.07367%	0.07360%	0.07354%	0.07348%	0.07313%	0.06867%

12/30のマネタリーベース			
12/30コール	合計	169,695	無担 56,840 有担 112,855
コール前日増減	計	▲ 4,527	無担 ▲ 1,989 有担 ▲ 2,538

1/6の加重平均レート(速報)				12/30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 ~0.130 (0.072)	0.040	~0.050	(0.041)			O/N	0.030 ~0.120 (0.068)			0.040	~0.050 (0.041)
0.070 ~0.123 (0.075)						T/N		0.120	(0.120)		
						S/N					
						1W		0.260	(0.260)		
0.180 ~0.298 (0.219)						2W		0.300	(0.300)		
						3W					
0.118 ~0.295 (0.125)				0.07-0.13	-	1M					有担先日付分
				0.07-0.13	-	2M					
				0.07-0.13	0.0550	3M					
				-	-	6M					
				-	-	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	1/8	~ 4/4 (86日間)	応札	3,300億円	落札	3,300億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	2,000億円	1/6	~ 1/7 (1日間)	応札	5億円	落札	5億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	2,500億円	1/8		応札	7,120億円	落札	2,505億円	按分利回り較差	0.000%	87.6%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	2,500億円	1/8		応札	11,498億円	落札	2,501億円	按分利回り較差	-0.005%	65.0%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	2,000億円	1/8		応札	4,061億円	落札	2,004億円	按分利回り較差	-0.012%	52.8%	平均利回り較差	-0.005%
ETF買入	208億円	約定日	1/6									

「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

あけましておめでとうございます。本年もよろしくお願ひ申し上げます。