

<<資金需給>>

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		7,700	6,000	5,000
財政		▲ 2,600	▲ 18,900	▲ 36,000
資金過不足		5,100	▲ 12,900	▲ 31,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			3,300	
177,496			▲ 4,300	
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		6,400	7,000	
CP等買入		▲ 300	▲ 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		▲ 200	200	
小計		6,100	6,100	0
当預増減		11,200	▲ 6,800	▲ 31,000

当座預金残高	1,108,100	1/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	997,800		18,400
積み終了先	854,800	1/8以降の残り所要積立額	
超過準備	854,700	積数	15,100
非準備先残高	110,300	1日平均	1,900
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	99.19% (実績)	74.19% (日数)	

1/6のマナターベース		2,036,900	
1/6コール	合計	177,082	無担 58,678 有担 118,404
コール前日増減	計	7,387	無担 1,838 有担 5,549

1/7の加重平均レート(速報)				1/6の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.060 ~0.085 (0.071)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.060 ~0.130 (0.072)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.072 ~0.120 (0.083)					0.070 ~0.123 (0.075)		
0.118 ~0.340 (0.122)					0.180 ~0.298 (0.219)		
0.118 (0.118)							
0.118 ~0.180 (0.125)		0.07-0.13	0.06-0.065	1M		0.118 ~0.295 (0.125)	有担先日付分
		0.07-0.13	-	2M			
		0.07-0.13	0.0584-0.0601	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 2,000億円 1/7 ~ 1/8 (1日間) 応札 205億円 落札 205億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 1/9~1/16 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.580%

米ドル資金供給(固定金利方式) 1/9~4/3 (84日間) 応札なし 貸付利率 0.590%

T-Bill3M 応札33兆6,332億円 落札5兆3,300億8,000万円(非競争入札:4,098億円) 1/9~4/7 0.0601% 按分10.0786% 平均0.0584%

10年利付国債(表面利率0.6%) 応札8兆3,669億円落札2兆1,777億円(I非競争入札:2,167億円) 1/9~2023/12/20 0.720%按分48.5405%平均0.719%

ETF買入 128億円 約定日 1/7

J-REIT買入 3億円 約定日 1/7

<< 1/8の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,101,300	前日比	▲ 6,800
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。

<< 7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2,000億円増の85兆6,000億円(当座預金残高見込は110兆8,000億円)。本日の無担O/Nは地銀・信託業態から0.07%前後での調達、大手行からは0.06%での調達希望と、昨日同様の展開で始まった。一巡後も、同水準で散発的に出合うなか、本日の取引を終了した。ターム物は、大手行から1M及び2W物で0.118%のまとまった調達が見られた。

<< 7日のオープン市場動向 >>
 現先レートT/Nは低位横ばいで推移。短国市場は3M物の入札が実施され、平均落札利回0.0584%、最高落札利回0.0601%と事前予想通りの順調な結果となった。セカンダリーは0.0584%~0.059%の出合いが見られた程度。CP市場は入札件数・発行額共に少なく総額1,200億円程度の出合いと閑散。発行レートは概ね横ばいで推移。

<< 8日の材料 >>
 *1月の日銀当座預金増減要因見込み
 *米国11月の消費者信用残高
 *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、1/17借入)

<<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%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	104.22-24
0.695 ▲ 0.030	15,814.37 ▲ 94.51	為替(5時)	104.35-37

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	12/25	12/26	12/27	12/30	1/6	1/7
日銀当預残	1,064,900	1,064,100	1,063,600	1,070,800	1,096,900	1,108,100
準備預金残	966,500	962,400	960,900	969,600	986,000	997,800
レート	0.072%	0.072%	0.073%	0.068%	0.072%	0.071%
月中平均	0.07360%	0.07354%	0.07348%	0.07313%	0.06867%	0.06900%

「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