

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		14日需給予想	15日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		3,100	3,300	5,000
財政		10,400	▲ 14,700	▲ 34,000
資金過不足		13,500	▲ 11,400	▲ 29,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)			2,100	
176,474			▲ 3,600	
国債買現				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		20,000		
国庫短期証売却				
国債買入		9,000		3,100
CP等買入				
		▲ 600	▲ 400	
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		100		
国債補完供給				
小計		28,500	▲ 1,900	3,100
当増増減		42,000	▲ 13,300	▲ 25,900

<< 1/14の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,093,800	前日比	▲ 13,300
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。

<< 10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4兆5,000億円増の88兆3,000億円(当座預金残高見込み110兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07%台前半での調達、大手行からは0.06%での調達希望が始まった。国債の償還で余剰日であったものの、一部資金偏在が起きているものと思われ、やや強めの展開となった。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が数件みられた。

<< 10日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばいで推移。短国市場は6M物の入札が実施され、平均落札利回0.0580%、最高落札利回0.0601%という結果。事前予想通りの入札結果であったが、セカンダリーではショートカバーと見られる買いから一部0.055%の出合いも見られた。CP市場は15日発行となり鉄鋼、不動産、電機業態からまとまった発行が見られ、総額1,500億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいながらも、一部で若干のレート上昇も見られた。

- << 14日の材料 >>**
- *11月の国際収支
 - *12月の景気ウォッチャー調査
 - *英国12月の消費者物価指数
 - *米国11月の米企業在庫 *米国12月の小売売上高
 - *預金保険機構借入(12カ月程度、1/22借入)

当座預金残高	1,107,100	1/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,005,700		10,500
積み終了先	877,300	1/14以降の残り所要積立額	
超過準備	877,200	積数	2,600
非準備先残高	101,400	1日平均	1,300
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)	1,871,800		
準備預金進捗率	99.86% (実績)	93.55% (日数)	

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	104.82-83
0.695 ▲ 0.050	15,912.06 31.73	為替(5時)	104.96-97

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	12/30	1/6	1/7	1/8	1/9	1/10
日銀当預残	1,070,800	1,096,900	1,108,100	1,101,600	1,065,100	1,107,100
準備預金残	969,600	986,000	998,200	990,800	970,300	1,005,700
レート	0.068%	0.072%	0.071%	0.071%	0.073%	0.074%
月中平均	0.07313%	0.06867%	0.06900%	0.06925%	0.06967%	0.07100%

1/9のマナタリーベース				1,986,400		
1/9コール	合計	180,265	無担	64,520	有担	115,745
コール前日増減	計	▲ 1,805	無担	▲ 1,284	有担	▲ 521

1/10の加重平均レート(速報)				1/9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 ~0.085 (0.074)	0.040 ~0.050 (0.041)					O/N	0.055 ~0.125 (0.073)	
0.072 ~0.120 (0.087)				T/N		0.072 ~0.130 (0.108)		
				S/N				
0.130 ~0.153 (0.142)				1W		0.100 ~0.400 (0.123)		
				2W		0.170 ~0.330 (0.216)		
				3W		0.155 (0.155)		
		0.07-0.13	-	1M			有担先日付分	
0.118 (0.118)		0.07-0.13	-	2M				
		0.07-0.13	0.063-0.064	3M				
		-	0.055-0.0605	6M		0.300 (0.300)		
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

CP買入	4,000億円	1/16	応札	10,380億円	落札	3,970億円	按分レート	0.079%	11.7%	平均落札レート	0.086%
国債買入	1,100億円	1/15	応札	7,064億円	落札	1,101億円	按分利回り較差	0.006%	17.7%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	2,000億円	1/15	応札	7,866億円	落札	2,007億円	按分利回り較差	-0.007%	48.4%	平均利回り較差	-0.006%
T-Bill6M	応札19兆4,591億円	落札3兆2,052億7,000万円	(非競争入札:2,946億4,000万円)	1/15~7/10	0.0601%	按分18.8159%	平均0.0580%				
ETF買入	128億円	約定日	1/10								

「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