

《資金需給》

単位 億円

	9日需給速報		13日需給予想		14日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		2,300		3,400		4,000
財政		2,800	▲	14,100	▲	26,000
資金過不足		5,100	▲	10,700	▲	22,000
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		78,671		900		▲ 1,500
国債買現		0				
CP買現		0				
国庫短期証買入		25,000				
国庫短期証売却						
国債買入		12,200				11,800
CP等買入		▲ 600		▲ 400		
貸出支援基金(成長)		44,583				
(増加)		189,789				
被災地支援		3,251				
社債等買入						
ETF買入		100		100		
国債補充供給						
小計		36,700		▲ 900		11,800
当預増減		41,800		▲ 11,600		▲ 10,200

1/13の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,799,500	前日比	▲ 11,600
O/N	0.06~0.08	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.07%程度の出合いが中心になると見込まれる。

《 9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、134兆7,000億円(当座預金残高見込みは181兆1,000億円)。本日朝方の無担O/Nは、大手行から0.068~0.07%程度、地銀・信託業態から0.07~0.077%の調達希望で始まった。3連休を挟む取引となる事から、やや強めの立ち上がりとなった。その後も出合いの水準は、0.07~0.075%程度で推移し、一日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W0.117%、2W・1M0.118%で調達を行った。

《 9日のオープン市場動向 》

短国現先レートは前日からほぼ変わらず。短国6M物の入札は按分レート▲0.0061%、平均レート▲0.0082%、按分比率77.6897%と事前予想通り堅調な結果となった。セカンダリーでは▲0.045~▲0.03%の出合いが見られた。その他、3M物では▲0.06~0.00%の出合いが見られた。CP市場は建設業態からの大型発行案件が見られ、発行総額は1,400億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動きであった。CP等買入オペは3,500億円の通知に対し、按分レート0.090%、平均レート0.094%となり、前回から按分・平均共にレートが上昇した。

《 12日の材料 》

*米国12月のFRB労働市場情勢指数

《 13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12月の財政収支

当座預金残高	1,811,100	1/9以降の残り所要積立額	5,500
準備預金残高	1,647,400	1/13以降の残り所要積立額	3,100
積み終了先	1,343,800	積数	1,000
超過準備	1,343,800	1日平均	1,977,100
非準備先残高	163,700		
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)			
準備預金進捗率	99.84% (実績)	90.32% (日数)	

JGB新発10年債	0.275	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,197.73	30.63	為替(9時)	119.79-81
						為替(5時)	119.43-45

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	1/5	1/6	1/7	1/8	1/9
日銀当預残	1,781,400	1,787,400	1,807,600	1,799,200	1,769,300	1,811,100
準備預金残	1,616,900	1,621,800	1,639,600	1,641,500	1,616,700	1,647,400
レート	0.066%	0.070%	0.071%	0.073%	0.074%	0.075%
月中平均	0.06745%	0.06680%	0.06750%	0.06829%	0.06900%	0.07100%

1/8のマナタリーベース		2,722,300	
1/8コール	合計 202,620	無担 85,583	有担 117,037
コール前日増減	計 916	無担 4,623	有担 ▲ 3,707

1/9の加重平均レート(速報)				1/8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		
0.060 ~0.135 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.125 (0.074)			0.030 ~0.040 (0.031)		
0.077 ~0.120 (0.086)				T/N	0.120 (0.120)				
				S/N					
0.084 ~0.125 (0.101)				1W	0.068 ~0.260 (0.130)				
0.118 ~0.310 (0.150)				2W	0.115 ~0.118 (0.116)				
				3W	0.118 (0.118)				
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.118 ~0.220 (0.134)			有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12	▲0.06-0.00	3M	0.200 (0.200)				
0.300 (0.300)		-	▲0.045-▲0.0061	6M					
		-	-	1Y					

《オペ情報、入札結果》

国債補完	2,000億円	1/9	~ 1/13 (4日間)	0億円	0億円	按分	平均	(即)
国債補完	2,000億円	1/9	~ 1/13 (4日間)	応札	落札	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	1/14	応札	6,773億円	落札	按分利回り較差	0.002%	8.5%
国債買入	4,000億円	1/14	応札	8,503億円	落札	按分利回り較差	0.005%	84.4%
国債買入	2,400億円	1/14	応札	6,445億円	落札	按分利回り較差	0.025%	57.3%
国債買入	1,400億円	1/14	応札	3,858億円	落札	按分利回り較差	0.016%	54.4%
CP買入	3,500億円	1/15	応札	10,452億円	落札	按分レート	0.090%	83.5%
T-Bill6M	応札25兆6,791億円	落札3兆2,317億3,000万円	(非競争入札:2,682億円)	1/14~7/10	▲0.0061%	按分77.6897%	平均▲0.0082%	

「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