

**<<資金需給>>**

単位 億円

	13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		3,400	2,100	2,000
財政		▲ 25,300	▲ 11,300	▲ 11,000
資金過不足		▲ 21,900	▲ 9,200	▲ 9,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
63,715				
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		9,500	8,900	
CP等買入		3,000		
		▲ 200	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 271,714				
被災地支援				
3,143				
社債等買入				
ETF買入			300	
国債補充供給				
小計		12,300	34,000	0
当預増減		▲ 9,600	24,800	▲ 9,000

<< 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	2,541,300	前日比	24,800
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07~0.08%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 13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7,000億円減の187兆4,000億円(当座預金残高見込みは251兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行・地銀・信託業態を中心に0.073~0.074%近辺の調達希望で始まり、まとまった金額に対しては0.075~0.076%程度での出合いも一部でみられた。一巡後は調達レートが低下し、0.07~0.074%程度の出合いが散見される中で本日の取引を終えた。ターム物については、出合いは閑散であった。

<< 13日のオープン市場動向 >>

短国現先レートS/Nは前日から横ばい圏で推移した。短国アウトライト市場はイベントが無く閑散な中、3Mが▲0.03%で小額の出合いが見られた。CP市場は償還総額1,000億円程度に対し、発行総額1,700億円程度。不動産、ノンバンク業態等からのまとまった発行案件が見られた。発行レートは、引き続き若干の上昇基調との印象であった。

<< 14日の材料 >>

- \*11月の機械受注統計(市場予想: 船舶・電力除く民需、前月比▲7.9%)
- \*11月の特定サービス産業動態統計速報 \*12月の企業物価指数
- \*英中銀MPC結果発表
- \*国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、1/18発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、1/22借入)

当座預金残高	2,516,500	1/13以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	2,317,400		
積み終了先	1,874,600	1/14以降の残り所要積立額	0
超過準備	1,874,600	積数	0
非準備先残高	199,100	1日平均	0
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額(積数)	2,053,000		
準備預金進捗率	100.00% (実績)	93.55% (日数)	

JGB新発10年債	0.205	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,715.63	496.67	為替(9時)	117.82-84
						為替(5時)	118.21-23

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	1/5	1/6	1/7	1/8	1/12	1/13
日銀当預残	2,549,000	2,538,800	2,520,100	2,534,900	2,526,100	2,516,500
準備預金残	2,325,800	2,316,300	2,313,200	2,328,800	2,324,500	2,317,400
レート	0.074%	0.075%	0.075%	0.077%	0.075%	0.075%
月中平均	0.05160%	0.05550%	0.05829%	0.06509%	0.06592%	0.06662%

1/12のマナターベース				3,531,400		
1/12コール	合計	230,335	無担	92,467	有担	137,868
コール前日増減	計	▲ 1,837	無担	657	有担	▲ 2,494

1/13の加重平均レート(速報)				1/12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	~0.125 (0.075)	0.030	~0.040 (0.031)			O/N	0.060	~0.125 (0.075)	0.030	~0.040 (0.031)
0.070	~0.120 (0.078)					T/N		0.070	~0.120 (0.079)	
						S/N				
0.114	(0.114)					1W		0.130	~0.240 (0.161)	
						2W		0.114	~0.310 (0.132)	
0.155	(0.155)					3W		0.155	(0.155)	
0.080	~0.155 (0.132)			0.07-0.12	-	1M				有担先日付分
				0.07-0.11	-	2M				
				0.07-0.11	▲0.03	3M				
				-	-	6M				
				-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

社債買入 1,000億円 1/19 応札 1,168億円 落札 987億円 全取レート -0.030% 平均落札レート 0.063%

10年物価連動国債(表面利率0.1%) 応札1兆2,328億円 落札4,999億円 1/15~2025/3/10 ▲0.364% 按分 20.5882%

「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