

<<資金需給>>

単位 億円

	26日需給速報		27日需給予想	28日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	▲ 100	▲ 1,000
財政		1,300	1,500	4,000
資金過不足		1,400	1,400	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
62,714				
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		13,000	5,100	
CP等買入		▲ 100	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 271,714				
被災地支援				
3,144				
社債等買入				
ETF買入		300	200	
国債補完供給				
小計		38,200	5,200	0
当預増減		39,600	6,600	3,000

1/27の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,589,700	前日比	6,600
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。

<< 26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4兆5,000億円増加の192兆9,000億円(当座預金残高見込みは258兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.073%近辺、地銀・信託業態から0.073~0.075%近辺の調達希望。朝方は0.075%近辺の出合いが中心。一巡後は0.07~0.075%のレンジでの出合いが見られた。一部の先からは試し取りによる0.125%での調達が見られた。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<< 26日のオープン市場動向 >>

現先S/N物は横ばい圏で推移。短国市場は、小動きな中、3Mゾーンが▲0.035~▲0.038%で堅調に推移した。CP市場は、ゼネコン・不動産・電力・ノンバンク等幅広い業態から大型の発行案件が見られ、発行総額は2,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは引続き概ね横ばいで推移。CP等買入オペがオファー額3,500億円で実施され、入札結果は平均落札利回0.074%・按分落札利回0.070%と前回(平均0.078%・按分0.073%)に比べて低下した。

<< 27日の材料 >>

- *米国FOMC(2日目)
- *米国12月の新築一戸建て販売件数

当座預金残高	2,583,100	1/26以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,364,100		55,100
積み終了先	1,911,800	1/27以降の残り所要積立額	
超過準備	1,911,200	積数	47,900
非準備先残高	219,000	1日平均	2,400
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			2,057,100
準備預金進捗率	97.67% (実績)		35.48% (日数)

JGB新発10年債	0.215	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	16,708.90	▲ 402.01	為替(9時)	118.22-23
						為替(5時)	117.77-79

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	1/19	1/20	1/21	1/22	1/25	1/26
日銀当預残	2,564,700	2,561,800	2,538,100	2,546,400	2,543,500	2,583,100
準備預金残	2,360,800	2,345,500	2,327,100	2,333,000	2,328,500	2,364,100
レート	0.076%	0.074%	0.075%	0.075%	0.075%	0.079%
月中平均	0.06926%	0.06950%	0.06976%	0.07042%	0.07060%	0.07092%

1/25のマナターベース			3,537,200			
1/25コール	合計	232,572	無担	87,961	有担	144,611
コール前日増減	計	1,945	無担	▲ 172	有担	2,117

1/26の加重平均レート(速報)				1/25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		
0.055 ~0.125 (0.079)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.073 ~0.121 (0.079)				T/N	0.050 ~0.125 (0.081)			
				S/N				
0.098 ~0.130 (0.104)				1W	0.099 ~0.130 (0.115)			
0.114 ~0.310 (0.134)				2W	0.077 ~0.114 (0.083)			
				3W				
		0.07-0.12	-	1M			有担先日付分	
		0.07-0.11	-	2M				
0.080 (0.080)		0.07-0.11	▲0.038	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

CP買入 3,500億円 1/29 応札 5,301億円 落札 3,498億円 按分レート 0.070% 39.7% 平均落札レート 0.074%

米ドル資金供給(固定金利方式) 1/28~2/4(7日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.840%

流動性供給 応札 1兆5,549億円 落札 4,989億円 1/28 募入最大利回較差 ▲0.007% 按分 85.2554% 募入平均利回較差 ▲0.009%

交付税特会 1兆500億円 2/4~8/4 応札 2兆7,800億円 落札 1兆500億100万円 0.079% 按分 77.7780% 平均 0.077%

ETF買入 352億円 約定日 1/26

「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