

**<<資金需給>>**

単位 億円

	28日需給速報		29日需給予想		30日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		700	100	▲ 2,000		
財政		7,100	▲ 3,000	▲ 1,000		
資金過不足		7,800	▲ 2,900	▲ 3,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
173,722						
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		7,300	4,400			
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		3,805				
社債等買入		▲ 400				
ETF買入			100			
国債補完供給						
小計		31,600	4,200	0		
当預増減		39,400	1,300	▲ 3,000		

当座預金残高	1,097,700	1/28以降の残り所要積立額	97,000
準備預金残高	989,600		
積み終了先	850,700	1/29以降の残り所要積立額	85,200
超過準備	849,000	積数	4,700
非準備先残高	108,100	1日平均	4,700
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,881,100		
準備預金進捗率	95.47% (実績)	41.94% (日数)	

1/27のマネタリーベース		1,962,500	
1/27コール	合計	175,746	無担 62,497 有担 113,249
コール前日増減	計	▲ 3,091	無担 ▲ 4,552 有担 1,461

1/28の加重平均レート(速報)				1/27の加重平均レート(確報)			
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 ~0.145 (0.070)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.060 ~0.145 (0.072)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.068 ~0.130 (0.082)					0.070 ~0.120 (0.082)		
0.125 (0.125)							
0.117 ~0.170 (0.150)					0.116 ~0.170 (0.131)		
0.118 ~0.330 (0.126)					0.115 ~0.118 (0.117)		
0.150 (0.150)							
		0.08-0.13	0.0500			0.118 ~0.153 (0.119)	有担先日付分
		0.08-0.13	-				
		0.08-0.13	0.0510				
		-	-				
		-	-				

**<<オペ情報、入札結果>>**

CP買入 4,000億円 1/31 応札 9,934億円 落札 3,764億円 按分レート 0.087% 24.6% 平均落札レート 0.091%  
 ミドル資金供給(固定金利方式) 1/30~2/6 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.580%  
 流動性供給 応札 1兆3,804億円 2,992億円 1/30 按分利回較差 ▲0.013% 按分 73.5760% 平均利回較差 ▲0.014%  
 交付税特会 1兆500億円 2/5~8/7 応札 3兆37億円 落札 1兆500億円 0.101% 按分 86.9207% 平均 0.101%

「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お客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。」

<< 1/29の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,099,000	前日比	1,300
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。

<< 28日のインターバンク市場動向 >>  
 午前8時発表の準備預金先残高見込は86兆4,000億円。朝方の無担O/Nは、信託・地銀業態から0.07%台前半、大手行からは0.06%台前半での調達希望。出合いの中心は0.07%。一巡後は調達レートが低下し、0.06~0.065%での出合いが散見される程度であった。ターム物に関しては、大手行が1W物0.117%、2W物0.118%で調達を行った。

<< 28日のオープン市場動向 >>  
 現先S/Nは低位安定。短国市場は、閑散とした状況の中、1M0.050%、3M0.051%で少額の出合いが見られた。CP市場は償還総額1,500億円程度に対し、電機・鉄鋼・石油業態から大型発行案件が見られたことで、発行総額は3,600億円程度と大幅な発行超過となった。発行レートは総じて小幅上昇。本日はCP等買入オペがオファー額4,000億円で実施された。市場での売却ニーズが強い銘柄が採用されたことや、入替ニーズも見られたことから、平均落札利回0.091% 按分落札利回0.087%と前回比で小幅上昇の結果となった。

<< 29日の材料 >>  
 \*米国FOMC(2日目)

JGB新発10年債	0.625	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	14,980.16	▲ 25.57	為替(9時)	102.66-68
						為替(5時)	102.78-79

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	1/21	1/22	1/23	1/24	1/27	1/28
日銀当預残	1,090,100	1,098,000	1,072,400	1,075,300	1,058,300	1,097,700
準備預金残	984,100	986,700	968,700	974,600	962,400	989,600
レート	0.071%	0.071%	0.072%	0.072%	0.072%	0.070%
月中平均	0.07114%	0.07114%	0.07117%	0.07127%	0.07130%	0.07125%

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