

◀資金需給▶

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想		31日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		0	▲ 400	▲ 400		
財政		▲ 2,700	▲ 3,400	▲ 1,600		
資金過不足		▲ 2,700	▲ 3,800	▲ 2,000		
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						
国庫短期証売却						
国債買入		4,400		6,000		
CP等買入				3,800		
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						
ETF買入		100				
国債補完供給						
小計		4,200	▲ 100	9,800		
当預増減		1,500	▲ 3,900	7,800		

当座預金残高	1,099,200	1/29以降の残り所要積立額	85,200
準備預金残高	985,800		
積み終了先	851,200	1/30以降の残り所要積立額	78,200
超過準備	850,300	積数	4.600
非準備先残高	113,400	1日平均	4.600
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	95.84% (実績)	45.16% (日数)	

1/28のマネタリーベース		2,001,300	
1/28コール	合計	176,936	無担 62,993 有担 113,943
コール前日増減	計	1,190	無担 496 有担 694

1/29の加重平均レート(速報)				1/28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 (0.091)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.060 ~0.145 (0.070)			
0.071 ~0.120 (0.100)					0.068 ~0.130 (0.082)		
					0.125 (0.125)		
0.073 ~0.295 (0.125)					0.117 ~0.170 (0.130)		
0.118 (0.118)					0.118 ~0.330 (0.121)		
0.150 (0.150)					0.150 (0.150)		
0.118 ~0.270 (0.161)		0.08-0.13	-		0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.13	-				
		0.08-0.13	0.05				
		-	-				
		-	-				

◀オペ情報、入札結果▶

国債買入	4,000億円	1/31	応札	8,828億円	落札	4,000億円	按分利回り較差	0.021%	40.0%	平均利回り較差	0.023%
国債買入	2,000億円	1/31	応札	5,325億円	落札	2,004億円	按分利回り較差	0.011%	70.5%	平均利回り較差	0.015%

「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。」

◀ 1/30の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,095,300	前日比	▲ 3,900
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。

◀ 29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85兆1,000億円。朝方の無担O/Nは、信託業態から0.07%台前半、地銀業態から0.06%台後半、大手行からは0.06%台前半の調達希望。出合いの中心は0.07%となった。一部業態でストレスチェックが行われたため、加重平均が上昇した。一巡後はビッドが切り下がり、0.06~0.065%近辺での出合いが散見される程度で取引を終えた。ターム物に関しては、昨日に続き大手行が1W物0.117%、2W物0.118%で調達を行っていた。

◀ 29日のオープン市場動向 ▶  
現先S/Nは短国・CP共に低位安定。短国市場では品薄感が強まるなか、売り物に乏しく閑散。CP市場では償還総額1兆1千億強に対し、発行総額は1兆円弱。発行レートは、3月末日に償還が嵩む銘柄や、発行額が大きい銘柄が上昇した。一方で、a-1格事業法人銘柄においては0.09%後半での結着が大半となっており、概ね横ばい圏での動きとなった。

◀ 30日の材料 ▶  
\*12月の商業販売統計速報  
\*米国10-12月期のGDP速報値  
\*国庫短期証券入札(3カ月、57,000億円、2/3発行)  
\*2年利付国債入札(29,000億円、2/15発行)  
\*預金保険機構借入(12カ月程度、2/7借入)

JGB新発10年債	0.635	0.010	日経平均株価(終値)	15,383.91	403.75	為替(9時)	103.24-25
						為替(5時)	103.12-14

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	1/22	1/23	1/24	1/27	1/28	1/29
日銀当預残	1,098,000	1,072,400	1,075,300	1,058,300	1,097,700	1,099,200
準備預金残	986,700	968,700	974,600	962,400	990,300	985,800
レート	0.071%	0.072%	0.072%	0.072%	0.070%	0.091%
月中平均	0.07114%	0.07117%	0.07127%	0.07130%	0.07125%	0.07193%

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