

**<<資金需給>>**

単位 億円

	30日需給速報		31日需給予想	3日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 500	0	0
財政		▲ 3,300	3,900	▲ 1,000
資金過不足		▲ 3,800	3,900	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				3,200
173,722				▲ 5,100
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			6,200	
CP等買入			3,800	
		▲ 100	▲ 3,700	
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				
国債補完供給				
小計		▲ 100	6,300	▲ 1,900
当預増減		▲ 3,900	10,200	▲ 2,900

当座預金残高	1,095,300	1/30以降の残り所要積立額	
準備預金残高	988,400		78,200
積み終了先	850,300	1/31以降の残り所要積立額	
超過準備	850,300	積数	70,600
非準備先残高	106,900	1日平均	4,400
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	96.25% (実績)	48.39% (日数)	

1/29のマネタリーベース		2,002,700	
1/29コール	合計	180,858	無担 70,234 有担 110,624
コール前日増減	計	3,922	無担 7,241 有担 ▲ 3,319

1/30 の加重平均レート(速報)			1/29 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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.060 ~0.145 (0.070)	0.040 ~0.050 (0.041)		O/N 0.060 ~0.145 (0.091)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.120 (0.120)			T/N	0.071 ~0.120 (0.100)		
0.125 (0.125)			S/N			
0.118 (0.118)			1W 0.295 (0.295)	0.073 ~0.145 (0.100)		
0.150 (0.150)			2W	0.118 (0.118)		
			3W	0.150 (0.150)		
		0.08-0.13	1M	0.118 ~0.270 (0.161)	有担当日付分	
		0.08-0.13	2M			
		0.08-0.13	3M			
		-	6M			
		-	1Y			

<< 1/31の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,105,500	前日比	10,200
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。

<< 30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%台前半での調達希望。出合いの中心は0.07~0.071%。一巡後はベストビッドが0.065%まで低下し、閑散な出合いで本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いはなく、ロール案件での出合いが散見される程度であった。

<< 30日のオープン市場動向 >>  
 現先S/N物は低位安定。短国市場は3M物入札(428回)入札が実施された。WI取引において0.048%でトレードが行われていたこともあり、落札結果は平均落札利回0.0486%、按分落札利回0.051%、按分率27.5013%と予想通りの結果となった。セカンダリーは足切レート近辺での出合いが見られた。CP市場は、償還総額500億円強に対し石油セクターから大型発行案件もあり1,000億円強に膨らんだ。発行レートは小幅上昇。

- << 31日の材料 >>
- \*12月の完全失業率(市場予想: 3.9%)
  - \*12月の家計調査(市場予想: 全世帯消費支出、前年比+1.2%)
  - \*12月の有効求人倍率(市場予想: 1.01倍)
  - \*12月全国・1月都区部消費者物価指数(CPI)
  - 市場予想: 全 国(12月)前年同月比(除く生鮮): +1.2%
  - 東京都区部(1月)前年同月比(除く生鮮): +0.7%
  - \*12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想: 前月比+1.2%)
  - \*12月の住宅着工統計
  - \*米国12月の個人所得・消費支出 \*米国1月のシカゴPM景況感指数
  - \*バーナンキFRB議長の任期満了
  - \*ユーロ圏1月消費者物価指数速報値
  - \*交付税特別会計借入(10,500億円、2/12借入)

JGB新発10年債	0.620	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	15,007.06	▲ 376.85	為替(9時)	102.28-30
						為替(5時)	102.34-36

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	1/23	1/24	1/27	1/28	1/29	1/30
日銀当預残	1,072,400	1,075,300	1,058,300	1,097,700	1,099,200	1,095,300
準備預金残	968,700	974,600	962,400	990,300	985,800	988,400
レート	0.072%	0.072%	0.072%	0.070%	0.091%	0.070%
月中平均	0.07117%	0.07127%	0.07130%	0.07125%	0.07193%	0.07187%

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通 8,000億円 2/3 ~ 4/28 (84日間) 応札 3,190億円 落札 3,190億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 T-Bill3M 応札30兆9,566億円 落札5兆1,704億7,000万円(非競争入札: 4,795億円) 2/3~5/7 0.0510% 按分27.5013% 平均0.0486%  
 2年利付国債(表面利率0.1%) 応札19兆695億円 落札2兆6,580億円(1 非競争入札: 2,393億円) 2/17~2016/2/15 0.084% 按分29.2967% 平均0.083%  
 預保借入(金融再生勘定・危機対応勘定) 792億円 2/7~2015/2/6 応札 3,633億円 落札 792億円 0.100% 按分95.768% 平均0.100%  
 ETF買入 128億円 約定日 1/30  
 J-REIT買入 3億円 約定日 1/30

「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