

<<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想		6日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,400		1,000		1,000
財政		▲ 32,600		▲ 100		▲ 23,000
資金過不足		▲ 31,200		900		▲ 22,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)				1,300		
171,772				▲ 1,200		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入		20,000				
国庫短期証売却						
国債買入		9,100		3,300		
CP等買入						
		▲ 100		▲ 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						
ETF買入				100		
国債補完供給	即日	▲ 100		100		
小計		28,900		3,300		0
当預増減		▲ 2,300		4,200		▲ 22,000

当座預金残高	1,094,300	2/4以降の残り所要積立額	39,200
準備預金残高	986,300		
積み終了先	853,400	2/5以降の残り所要積立額	34,000
超過準備	853,400	積数	3,100
非準備先残高	108,000	1日平均	3,100
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,874,200		
準備預金進捗率	98.19% (実績)	64.52% (日数)	

2/3のマナターベース		1,998,900	
2/3コール	合計	169,939	無担 59,661 有担 110,278
コール前日増減	計	▲ 1,362	無担 ▲ 1,002 有担 ▲ 360

2/4の加重平均レート(速報)				2/3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
0.055 ~0.145 (0.082)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.125 (0.074)			0.040 ~0.050 (0.041)
0.070 ~0.130 (0.093)				T/N			0.070 ~0.130 (0.098)
0.125 (0.125)				S/N			0.100 ~0.125 (0.101)
0.117 ~0.170 (0.131)				1W			0.095 ~0.170 (0.120)
0.118 ~0.340 (0.160)				2W			0.095 ~0.118 (0.115)
0.116 (0.116)				3W			
0.118 ~0.300 (0.121)		0.08-0.13	-	1M		0.118 (0.118)	有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	-	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 1,205億円 2/4 ~ 2/5 (1日間) 応札 129億円 落札 129億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 2/6~2/14 (8日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.580%

米ドル資金供給(固定金利方式) 2/6~5/2 (85日間) 応札なし 貸付利率 0.580%

10年利付国債(表面利率0.6%) 応札 7兆516億円 落札 2兆1,941億円 (I 非競争入札: 2,012億円) 2/6~2023/12/20 0.600% 按分 80.6348% 平均 0.596%

交付税特会 1兆500億円 2/19~8/20 応札 3兆2,425億円 落札 1兆500億円 0.101% 按分 16.3124% 平均 0.100%

ETF買入 123億円 約定日 2/4

J-REIT買入 3億円 約定日 2/4

<< 2/5の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,098,500	前日比	4,200
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。

<< 4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は、前日比5,000億円減少の86兆円(当座預金残高見込は109兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは大手行から0.06%、地銀および信託業態から0.07%近辺の調達希望から始まり、0.07~0.071%程度の取引からの立ち上がりとなった。本日は税揚げ日であったものの、前日同様に調達意欲は総じて弱め。出し取り一巡後は地銀、信託業態の調達意欲が減退し、大手行を中心に0.065%前後の水準で散発的に取引が見られる程度であった。また、ストレスチェックと見られる試し取りが散見されたことで、加重平均レートは上昇した。ターム物は大手行が1W物0.117%、2W物および1M物0.118%で調達を行った。

<< 4日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、ファンディングニーズが弱いことから、引き続き低位横ばい。短国市場は、目下の下限水準で推移していることから目立った出合いが見られず。全般的に様子見閑散であった。CP市場は、ノンバンク・石油業態からまとまった発行が実施されたことで総額1,000億程度の発行。発行レートは概ね横ばいながらも、残高が積み上がっている一部の銘柄では小幅上昇となった。

- << 5日の材料 >>**
- *12月の毎月勤労統計調査速報
 - *米国1月のISM非製造業景況指数
 - *英中銀金融政策委員会(MPC、1日目)
 - *国庫短期証券入札(6カ月、35,000億円、2/10発行)

<<コール1月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07184%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07258%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.18-20
0.605 ▲ 0.005	14,008.47 ▲ 610.66	為替(5時)	101.09-10

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	1/28	1/29	1/30	1/31	2/3	2/4
日銀当預残	1,097,700	1,099,200	1,095,300	1,104,900	1,096,600	1,094,300
準備預金残	990,300	985,800	989,000	1,000,000	990,800	986,300
レート	0.070%	0.091%	0.070%	0.071%	0.074%	0.082%
月中平均	0.07125%	0.07193%	0.07187%	0.07184%	0.07200%	0.07450%

「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