

<<資金需給>>

単位 億円

	5日需給速報		6日需給予想	7日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,400	200	0
財政		▲ 700	▲ 23,800	1,000
資金過不足		700	▲ 23,600	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,300		
171,812		▲ 1,200		
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		3,300		9,000
CP等買入				
		▲ 300	▲ 400	
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	200	
国債補完供給		100		
小計		3,300	▲ 200	9,000
当預増減		4,000	▲ 23,800	10,000

当座預金残高	1,098,300	2/5以降の残り所要積立額	34,000
準備預金残高	993,500	2/6以降の残り所要積立額	積数
積み終了先	862,400		28,800
超過準備	862,400	1日平均	2,900
非準預先残高	104,800	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	98.46% (実績)		67.74% (日数)

2/4のマナターベース		1,995,200	
2/4コール合計	176,232	無担	67,602
		有担	108,630
コール前日増減	計	6,293	無担
		7,941	有担
			▲ 1,648

2/5の加重平均レート(速報)				2/4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		有担当日分	
0.060 ~0.145 (0.080)	0.040 ~0.050 (0.041)							0.055 ~0.145 (0.082)	
0.070 ~0.130 (0.106)							0.070 ~0.130 (0.093)		
							0.125 (0.125)		
0.117 ~0.295 (0.123)							0.117 ~0.170 (0.131)		
0.180 (0.180)							0.118 ~0.340 (0.146)		
0.116 (0.116)							0.116 (0.116)		
0.190 (0.190)				0.08-0.13	0.0470		0.118 ~0.300 (0.119)	有担先日付分	
				0.08-0.13	-				
0.125 (0.125)				0.08-0.13	0.0500				
				-	0.044-0.050				
				-	0.048-0.049				

<<オペ情報、入札結果>>

CP買入	4,000億円	2/10	応札	8,800億円	落札	3,932億円	按分レート	0.085%	43.2%	平均落札レート	0.088%
国債買入	2,500億円	2/7	応札	8,122億円	落札	2,504億円	按分利回り較差	0.001%	72.4%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	2,500億円	2/7	応札	12,775億円	落札	2,501億円	按分利回り較差	0.004%	83.4%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	2/7	応札	8,032億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	0.003%	2.9%	平均利回り較差	0.006%

T-Bill6M 応札23兆7,736億円 落札3兆2,546億9,000万円(非競争入札:2,452億3,000万円) 2/10~8/11 0.0501% 按分83.7656% 平均0.0501%

「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

<< 2/6の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,074,500	前日比	▲ 23,800
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。

<< 5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6,000億円増加の86兆6,000億円(当座預金残高見込は109兆9,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06~0.065%、地銀および信託業態から0.07%近辺の調達希望から始まった。取引は0.07~0.071%程度の取引を中心にスタートし、前日までの地合いを引き継いだ落ち着いた立ち上がりとなった。一巡後は0.065~0.07%程度の取引で出合いが見られたほか、本日もストレスチェックによる0.125%程度の取引も確認された。午後は調整程度の取引が見られた程度で本日の取引を終了した。ターム物は目立った引き合いに乏しく、閑散とした地合いであった。

<< 5日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、低位横ばいで推移した。短国市場は、6M物の入札が実施され、最高・平均共に落札利回0.0501%、按分比率83.7656%と概ね予想通りの堅調な結果であった。アウトライトは、1M:0.047%、3M:0.05%、6M:0.044~0.050%、1Y:0.048~0.049%で出合っており、6M物は入札後に買い進む動きが見られた。CP市場は、石油業態からまとまった発行が実施されたが、発行総額は1,200億円程度にとどまった。発行レートは、横ばい圏で変わらず。

<< 6日の材料 >>
 *岩田日銀副総裁、宮崎県金融経済懇談会にて講演
 *米国12月の貿易収支 *英中銀金融政策委員会(MPC、2日目)
 *E C B 定例理事会(金融政策発表)
 *国庫短期証券入札(3カ月、57,000億円、2/10発行)
 *30年利付国債入札(5,000億円、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	0.600	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	14,180.38	171.91	為替(9時)	101.70-71
						為替(5時)	101.23-25

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	1/29	1/30	1/31	2/3	2/4	2/5
日銀当預残	1,099,200	1,095,300	1,104,900	1,096,600	1,094,300	1,098,300
準備預金残	985,800	989,000	1,000,000	990,800	987,300	993,500
レート	0.091%	0.070%	0.071%	0.074%	0.082%	0.080%
月中平均	0.07193%	0.07187%	0.07184%	0.07200%	0.07450%	0.07560%