

<<資金需給>>

単位 億円

	6日需給速報		7日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	▲ 400	1,000
財政		▲ 24,400	1,800	▲ 15,000
資金過不足		▲ 24,300	1,400	▲ 14,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				1,200
171,812				▲ 3,200
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			9,100	
CP等買入				3,900
		▲ 400	▲ 500	
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		200		
国債補完供給				
小計		▲ 200	8,600	1,900
当預増減		▲ 24,500	10,000	▲ 12,100

当座預金残高	1,073,800	2/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	970,100		28,800
積み終了先	846,500	2/7以降の残り所要積立額	
超過準備	843,000	積数	21,300
非準備先残高	103,700	1日平均	2,400
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	98.86% (実績)	70.97% (日数)	

2/5のマネタリーベース				1,997,800
2/5コール	合計	182,354	無担	76,866
			有担	105,488
コール前日増減	計	6,122	無担	9,264
			有担	▲ 3,142

2/6の加重平均レート(速報)			2/5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	
0.055 ~0.145 (0.079)	0.040 ~0.050 (0.041)		O/N 0.060 ~0.145 (0.080)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.070 ~0.125 (0.089)			T/N	0.070 ~0.130 (0.107)		
			S/N			
0.095 ~0.117 (0.098)			1W 0.295 (0.295)	0.117 ~0.120 (0.117)		
0.180 (0.180)			2W	0.180 (0.180)		
			3W	0.116 (0.116)		
0.118 ~0.180 (0.149)		0.08-0.13	1M	0.190 (0.190)		有担先日付分
		0.08-0.13	2M			
		0.08-0.13	3M	0.125 (0.125)		
		-	6M			
		-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 2/10 ~ 5/12 (91日間) 応札 1,220億円 落札 1,220億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札 36兆6,554億円 落札 5兆3,027億円(非競争入札:4,272億円) 2/10~5/12 0.0501% 按分 35.3326% 平均 0.0493%
 30年利付国債(表面利率1.7%) 応札 1兆5,671億円 落札 4,574億円(I 非競争入札:424億円) 2/10~2043/12/20 1.600% 按分20.2380% 平均1.587%

「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

2/7の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,083,800	前日比	10,000
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。

<< 6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1兆4,000億円減少の85兆2,000億円(当座預金残高見込は107兆5,000億円)。10年債の発行日にあたったものの、無担O/Nは、大手行から0.06%、信託業態等から0.07%の調達希望で、0.07%付近の出合いからの立ち上がりと特段の変化は見られず。一巡後には、一部業態からストレスチェックの動きも見られたが、実需は概ね0.06%台の取引で軟調に推移した。午後は調整程度の取引に終始し、本日のマーケットを終えた。ターム物はロールオーバーの案件が散見された程度であった。

<< 6日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、国債の発行が重なったことでやや上昇した。短国市場は、3M物の入札が実施され、最高落札利回0.0501%、平均落札利回0.0493%、按分率35.3326%と堅調な結果であった。アウトライイト市場では1M:0.045%、2M:0.046%、3M:0.048~0.050%、6M:0.043%、1Y:0.048%で出合っており僅かに目線が切り下がっている。CP市場は、発行日が「5・10日」に該当するものの、入札ベースの総額は2,000億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい。

<< 7日の材料 >>
 *12月の景気動向指数速報
 *1月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *米国12月の消費者信用残高 *米国1月の雇用統計

《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)	101.47-48
0.610 0.010	14,155.12 ▲ 25.26	為替(5時)	101.49-50

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	1/30	1/31	2/3	2/4	2/5	2/6
日銀当預残	1,095,300	1,104,900	1,096,600	1,094,300	1,098,300	1,073,800
準備預金残	989,000	1,000,000	990,800	987,300	993,500	970,100
レート	0.070%	0.071%	0.074%	0.082%	0.080%	0.079%
月中平均	0.07187%	0.07184%	0.07200%	0.07450%	0.07560%	0.07617%