

<<資金需給>>

単位 億円

	7日需給速報		10日需給予想	12日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	800	1,000
財政		1,600	▲ 20,200	2,000
資金過不足		1,200	▲ 19,400	3,000
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				20,000
国庫短期証売却				
国債買入		9,100		3,100
CP等買入		▲ 500	3,900	▲ 600
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		8,600	1,400	23,100
当預増減		9,800	▲ 18,000	26,100

当座預金残高	1,083,600	2/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	977,600		21,300
積み終了先	857,700	2/10以降の残り所要積立額	
超過準備	854,300	積数	12,300
非準備先残高	106,000	1日平均	2,100
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			1,883,900
準備預金進捗率	99.35% (実績)		80.65% (日数)

2/6のマナターベース		1,973,100	
2/6コール	合計	175,936	無担 67,913 有担 108,023
コール前日増減	計	▲ 6,418	無担 ▲ 8,953 有担 2,535

2/7の加重平均レート(速報)				2/6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 (0.072)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.055 ~0.145 (0.079)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.071 ~0.120 (0.081)				T/N	0.070 ~0.125 (0.089)		
0.125 (0.125)				S/N			
0.116 ~0.400 (0.182)				1W	0.095 ~0.117 (0.098)		
0.170 ~0.330 (0.234)				2W	0.180 (0.180)		
				3W			
		0.08-0.13	0.0450	1M	0.118 ~0.180 (0.149)		有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.045-0.048	3M			
		-	-	6M			
		-	0.0460	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	20,000億円	2/12	応札	44,862億円	落札	20,009億円	按分利回り較差	-0.004%	13.2%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	1,100億円	2/12	応札	4,953億円	落札	1,105億円	按分利回り較差	0.000%	89.2%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	2,000億円	2/12	応札	5,656億円	落札	2,003億円	按分利回り較差	0.023%	26.6%	平均利回り較差	0.029%

「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録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

<< 2/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,065,600	前日比	▲ 18,000
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。

<< 7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みは、前日比7,000億円増加の85兆9,000億円(当座預金残高見込みは108兆4,000億円)。本日の無担O/Nは0.07~0.071%の取引から立ち上がり、大手行から0.06%、信託から0.07%付近の調達希望。週末日となることもあり、ストレスチェックの動きは限定的であった。一巡後は0.06~0.07%のレンジでの取引で推移した。午後は一部調整の動きが見られた程度で、閑散とした地合いの中、本日の取引を終えた。ターム物は大手行が1M物を0.118%で調達していた。

<< 7日のオープン市場動向 >>
現先レートS/Nは、引続き横ばい圏で推移した。短国市場は、短国買入オペが2兆円オファーされたことから、堅調な展開となった。短国買入オペの結果は、平均落札利回▲0.002%、按分落札利回▲0.004%、按分率13.2%。アウトライト市場での出合いは1M:0.045%、3M:0.045~0.048%、1Y:0.046%の出合いが見られている。CP市場は、入札ベースの発行総額1,400億円程度。投資家・ディーラーの購入意欲が堅調であることから、発行レートは概ね同水準であった。

<< 10日の材料 >>
*12月の国際収支
*12月の特定サービス産業動態統計速報
*1月の消費動向調査
*1月の景気ウォッチャー調査

JGB新発10年債	0.620	0.010	日経平均株価(終値)	14,462.41	307.29	為替(9時)	102.04-05
						為替(5時)	102.11-13

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	1/31	2/3	2/4	2/5	2/6	2/7
日銀当預残	1,104,900	1,096,600	1,094,300	1,098,300	1,073,800	1,083,600
準備預金残	1,000,000	990,800	987,300	993,500	970,500	977,600
レート	0.071%	0.074%	0.082%	0.080%	0.079%	0.072%
月中平均	0.07184%	0.07200%	0.07450%	0.07560%	0.07617%	0.07478%