

**<<資金需給>>**

単位 億円

	27日需給速報		28日需給予想	29日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		600	400	0
財政		8,900	3,400	▲ 4,000
資金過不足		9,500	3,800	▲ 4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
75,979				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		30,000		
国庫短期証売却				
国債買入		12,300	4,400	
CP等買入				
		▲ 100	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789				
被災地支援				
3,252				
社債等買入			▲ 100	
ETF買入			400	
国債補完供給				
小計		42,200	4,500	0
当預増減		51,700	8,300	▲ 4,000

当座預金残高	1,833,800	1/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,657,100		59,400
積み終了先	1,346,800	1/28以降の残り所要積立額	
超過準備	1,345,900	積数	53,300
非準備先残高	176,700	1日平均	2,800
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			1,978,000
準備預金進捗率	97.31% (実績)		38.71% (日数)

1/26のマナターベース		2,719,000	
1/26コール	合計	200,301	無担 79,501 有担 120,800
コール前日増減	計	4,732	無担 2,886 有担 1,846

1/27の加重平均レート(速報)				1/26の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.060 ~0.125 (0.073)	0.030	~0.040 (0.031)		0.060 ~0.125 (0.071)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.071 ~0.120 (0.077)						0.073 ~0.120 (0.083)		
						0.125 (0.125)		
0.117 (0.117)						0.117 ~0.119 (0.118)		
0.118 (0.118)						0.118 ~0.310 (0.119)		
0.114 (0.114)						0.118 (0.118)		
		0.08-0.12	-					有担先日付分
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	▲0.005					
		-	-					
		-	-					

1/28の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,842,100	前日比	8,300
O/N	0.06~0.08	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.07~0.075%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 27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4兆7,000億円増加の135兆4,000億円(当座預金残高見込みは183兆3,000億円)。無担O/Nは、大手行から0.068%、地銀および信託業態から0.069~0.072%の調達希望で始まり、出合いの中心レートは0.07%近辺であった。一巡後以降は0.068~0.07%近辺で出合いが散見され、本日の取引を終了した。ターム物に関しては、大手行から1W物は0.117%、2W物は0.118%で調達が行われた。

<< 27日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは、若干低下して推移した。短国市場は、3M▲0.005%で小額の出合いが見られた程度で、一日を通して閑散であった。CP市場は、様々な業態から大型の発行が実施され、発行総額は4,000億円程度となった。買い意欲がやや弱まっており、発行レートの目線が若干上昇した。CP等買入オペが実施され、平均・按分ともに前回より若干低下した。

<< 28日の材料 >>  
 \*米国FOMC(2日目)  
 \*預金保険機構借入(12ヶ月程度、2/6借入)

JGB新発10年債	0.265	0.040	日経平均株価(終値)	17,768.30	299.78	為替(9時)	118.51-53
						為替(5時)	118.03-05

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	1/20	1/21	1/22	1/23	1/26	1/27
日銀当預残	1,785,500	1,828,300	1,797,800	1,803,100	1,782,100	1,833,800
準備預金残	1,615,600	1,660,200	1,630,000	1,630,500	1,615,400	1,657,100
レート	0.077%	0.074%	0.075%	0.073%	0.071%	0.073%
月中平均	0.07230%	0.07238%	0.07250%	0.07256%	0.07250%	0.07252%

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完 4,000億円 1/27 ~ 1/28 (1日間) 0億円 0億円 按分 平均 (即)  
 CP買入 3,500億円 1/30 応札 11,442億円 落札 3,471億円 按分レート 0.091% 84.6% 平均落札レート 0.094%

米ドル資金供給(固定金利方式) 1/29~2/5 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.630%

流動性供給 応札 1兆4,453億円 落札 3,996億円 1/29 募入最大利回較差 ▲0.012% 按分 33.1395% 募入平均利回較差 ▲0.015%

交付税特会 1兆500億円 2/4~8/6 応札 2兆9,530億円 落札 1兆500億円 0.090% 按分 64.9352% 平均 0.089%

「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