

<<資金需給>>

単位 億円

	30日需給速報		2日需給予想	3日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	1,600	2,000
財政		1,300	▲ 33,600	▲ 1,000
資金過不足		1,000	▲ 32,000	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			800	
75,979			▲ 1,600	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				25,000
国庫短期証売却				
国債買入		12,100		12,000
CP等買入		3,500		
		▲ 3,800	▲ 600	
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	▲ 100	
ETF買入			400	
国債補完供給				
小計		11,700	▲ 1,100	37,000
当預増減		12,700	▲ 33,100	38,000

当座預金残高	1,849,300	1/30以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,683,200		44,000
積み終了先	1,386,400	2/2以降の残り所要積立額	
超過準備	1,385,000	積数	30,300
非準備先残高	166,100	1日平均	2,200
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			1,976,300
準備預金進捗率	98.47%	(実績)	54.84% (日数)

1/29のマナターベース		2,773,100	
1/29コール	合計	203,382	無担 80,633 有担 122,749
コール前日増減	計	▲ 10,433	無担 ▲ 11,852 有担 1,419

1/30の加重平均レート(速報)				1/29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 ~0.080 (0.071)	0.030	~0.040	(0.031)					0.060 ~0.135 (0.071)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.069 ~0.123 (0.076)								0.073 ~0.123 (0.075)	
0.150 ~0.260 (0.178)								0.075 ~0.117 (0.090)	
0.118 ~0.145 (0.119)								0.118 (0.118)	
				0.08-0.12	-			0.118 (0.118)	
				0.08-0.12	-				有担当日付分
				0.08-0.12	▲0.006-0.000				
				-	-				
				-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	1/30	~ 2/2 (3日間)	応札	26億円	落札	26億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	25,000億円	2/3		応札	40,788億円	落札	25,002億円	按分利回り較差	0.001%	92.5%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	2/3		応札	13,996億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	0.006%	1.3%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,000億円	2/3		応札	13,690億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.005%	75.4%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	2/3		応札	14,830億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.005%	10.9%	平均利回り較差	0.007%
交付税特会	1兆500億円	2/12~8/12		応札	3兆6,725億円	落札	1兆500億円	0.090%	按分	2.4716%	平均	0.088%

「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

<< 2/2の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,816,200	前日比	▲ 33,100
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%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 30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2兆2,000億円増加の138兆5,000億円(当座預金残高見込みは184兆9,000億円)。朝方の無担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%の調達希望で始まった。出合いの中心レートは0.07%近辺であった。一巡後は0.069~0.071%近辺で出合いが散見されつつ、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。

<< 30日のオープン市場動向 >>
現先レートS/Nは、横ばい圏で推移した。短国市場は、買入オペが前回比5,000億円減額の25,000億円でオファーされた。結果は、按分利回り較差0.001%、平均利回り較差0.005%、按分率92.5%と概ね実勢通りとなった。また、応札額が40,788億円と前回の7兆3,892億円と大幅に減少した。アウトライイト市場では、3M▲0.006~0.000%での出合いが見られた。CP市場は、卸売・石油業態からまとまった発行が実施され、発行総額は1,200億円程度となった。発行レートは前日とほぼ同水準であった。

<< 2日の材料 >>
*1月実績/2月見込み財政資金対民間収支
*米国12月の建設支出
*米国1月の個人所得・消費支出
*米国1月のISM製造業景況指数

<<コール1月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07284%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07389%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.275	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	17,674.39	68.17	為替(9時)	118.26-28
						為替(5時)	117.89-90

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	1/23	1/26	1/27	1/28	1/29	1/30
日銀当預残	1,803,100	1,782,100	1,833,800	1,841,700	1,836,600	1,849,300
準備預金残	1,630,500	1,615,400	1,657,800	1,653,200	1,663,000	1,683,200
レート	0.073%	0.071%	0.073%	0.087%	0.071%	0.071%
月中平均	0.07256%	0.07250%	0.07252%	0.07304%	0.07297%	0.07284%

1/30の加重平均レート(速報)				1/29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 ~0.080 (0.071)	0.030	~0.040	(0.031)					0.060 ~0.135 (0.071)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.069 ~0.123 (0.076)								0.073 ~0.123 (0.075)	
0.150 ~0.260 (0.178)								0.075 ~0.117 (0.090)	
0.118 ~0.145 (0.119)								0.118 (0.118)	
				0.08-0.12	-			0.118 (0.118)	
				0.08-0.12	-				有担当日付分
				0.08-0.12	▲0.006-0.000				
				-	-				
				-	-				