

<<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,500	1,200	1,000
財政		▲ 33,600	▲ 31,400	▲ 30,000
資金過不足		▲ 32,100	▲ 30,200	▲ 29,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		800		
75,199		▲ 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			12,000	4,500
CP等買入				
		▲ 600	▲ 300	
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		▲ 1,100	36,700	4,500
当預増減		▲ 33,200	6,500	▲ 24,500

当座預金残高	1,816,100	2/2以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,649,400		30,300
積み終了先	1,352,600	2/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,352,600	積数	26,600
非準備先残高	166,700	1日平均	2,000
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	98.65%	(実績)	58.06% (日数)

1/30のマネタリーベース		2,786,100	
1/30コール	合計	202,984	無担 79,007 有担 123,977
コール前日増減	計	▲ 398	無担 ▲ 1,626 有担 1,228

2/2の加重平均レート(速報)				1/30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	短国	無担当日分		有担当日分
0.060 ~0.135 (0.071)	0.030	~0.040 (0.031)				0.060 ~0.080 (0.071)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.070 ~0.120 (0.076)							0.069 ~0.123 (0.076)	
0.117 (0.117)							0.117 ~0.260 (0.142)	
0.118 (0.118)							0.118 ~0.145 (0.119)	
0.118 (0.118)				0.08-0.12	-			有担先日付分
				0.08-0.12	-			
				0.08-0.12	▲0.01			
				-	-			
				-	-			
				-	-			

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	700億円	2/4	応札	1,552億円	落札	704億円	按分利回り較差	0.000%	60.5%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	2,400億円	2/4	応札	6,180億円	落札	2,405億円	按分利回り較差	-0.012%	79.5%	平均利回り較差	-0.011%
国債買入	1,400億円	2/4	応札	4,887億円	落札	1,402億円	按分利回り較差	-0.017%	57.1%	平均利回り較差	-0.012%
ETF買入	341億円	約定日	2/2								
J-REIT買入	12億円	約定日	2/2								

「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

<< 2/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,822,600	前日比	6,500
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

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。

<< 2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2兆7,000億円減少の135兆8,000億円(当座預金残高見込みは181兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.068%、地銀・信託業態から0.069~0.071%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.07~0.071%を中心とした出合いとなった。その後も、一日を通して0.07%近辺で底堅く推移した。ターム物は、1W~2Wの期間で大手行による幅広い調達が行なわれていた。

<< 2日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは月初の運用ニーズから小幅低下基調で推移した。短国アウトライト市場は閑散で、3M▲0.01%の出合いが見られた程度であった。CP市場は件数が少なく、発行総額は500億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となっていた。

<< 3日の材料 >>
 *1月のマネタリーベース
 *2月の日銀当座預金増減要因見込み
 *米国12月の製造業新規受注・出荷・在庫
 *10年利付国債入札(24,000億円、2/5発行)

<<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	0.280	0.005	日経平均株価(終値)	17,558.04	▲ 116.35	為替(9時)	117.18-20
						為替(5時)	117.58-59

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	1/26	1/27	1/28	1/29	1/30	2/2
日銀当預残	1,782,100	1,833,800	1,841,700	1,836,600	1,849,300	1,816,100
準備預金残	1,615,400	1,657,800	1,653,200	1,663,000	1,683,200	1,649,400
レート	0.071%	0.073%	0.087%	0.071%	0.071%	0.071%
月中平均	0.07250%	0.07252%	0.07304%	0.07297%	0.07284%	0.07100%

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