

<<資金需給>>

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想		5日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,200	1,100	0		
財政		▲ 31,300	▲ 26,300	▲ 20,000		
資金過不足		▲ 30,100	▲ 25,200	▲ 20,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
75,199						
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	4,900			
CP等買入						
		▲ 300	▲ 100			
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						
ETF買入			100			
国債補充供給						
小計		36,700	4,900	0		
当増減		6,600	▲ 20,300	▲ 20,000		

当座預金残高	1,822,700	2/3以降の残り所要積立額	26,600
準備預金残高	1,654,000	2/4以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,358,800	積数	22,800
超過準備	1,358,700	1日平均	1,900
非準備先残高	168,700	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	98.85% (実績)		61.29% (日数)

2/2のマナタリーベース		2,751,300	
2/2コール合計	201,554	無担	78,965
コール前日増減	▲ 1,430	無担	▲ 42
		有担	▲ 1,388

2/3の加重平均レート(速報)			2/2の加重平均レート(確報)		
無担(平均)	有担(平均)	CP配a-1	短国	無担当日分	無担先日付分
0.050 ~0.135 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.135 (0.071)	
0.071 ~0.123 (0.074)				T/N	0.070 ~0.120 (0.076)
				S/N	
0.117 ~0.119 (0.118)				1W	0.117 (0.117)
0.118 ~0.310 (0.121)				2W	0.118 (0.118)
				3W	
0.118 ~0.630 (0.126)		0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.015-▲0.012	3M	
		-	-	6M	
		-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 2/5~2/12 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.630%
 10年利付国債(表面利率0.3%) 応札5兆8,822億円 落札2兆1,912億円(I非競争入札:2,064億円) 2/5~2024/12/20 0.360% 按分10.9581% 平均0.313%
 ETF買入 327億円 約定日 2/3
 J-REIT買入 12億円 約定日 2/3

「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

2/4の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,802,400	前日比	▲ 20,300
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。

<< 3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5,000億円増加の136兆3,000億円(当座預金残高見込みは182兆3,000億円)。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0.071%を中心とした出合い。昨日とほぼ同様の展開となり、一日を通して0.07%近辺での出合いで底堅く推移した。ターム物は、1W~2Wの期間で大手行によるまとまった調達が確認された。

<< 3日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは運用ニーズが強く、横ばい圏で推移した。短国アウトライト市場は閑散で、3M▲0.015~▲0.012%の出合いが見られた程度であった。CP市場は5日発行にあたったことで発行額が膨らみ、リース・鉄鋼業態を中心に2,700億円程度の出合いとなった。大型案件が多かったため、発行レートは小幅上昇となった。

<< 4日の材料 >>
 *岩田日銀副総裁、宮城県金融経済懇談会にて講演
 *12月の毎月勤労統計調査速報(厚生労働省 10:30)
 *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
 *米国1月のISM非製造業景況指数
 *交付税特別会計借入(10,500億円、2/18借入)

《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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	117.60-62
0.360 0.080	17,335.85 ▲ 222.19	為替(5時)	117.22-23

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	1/27	1/28	1/29	1/30	2/2	2/3
日銀当預残	1,833,800	1,841,700	1,836,600	1,849,300	1,816,100	1,822,700
準備預金残	1,657,800	1,653,200	1,663,000	1,683,200	1,650,600	1,654,000
レート	0.073%	0.087%	0.071%	0.071%	0.071%	0.073%
月中平均	0.07252%	0.07304%	0.07297%	0.07284%	0.07100%	0.07167%