

**<<資金需給>>**

単位 億円

	6日需給速報		9日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	1,100	1,000
財政		▲ 2,900	▲ 25,100	▲ 8,000
資金過不足		▲ 2,700	▲ 24,000	▲ 7,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		13,600	2,200	3,600
78,798		▲ 10,000	▲ 2,400	▲ 4,700
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入		12,000		11,800
CP等買入				4,000
		▲ 500	▲ 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				
ETF買入		300	300	
国債補充供給				
小計		15,400	▲ 200	14,700
当預増減		12,700	▲ 24,200	7,700

当座預金残高	1,796,800	2/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,632,700		16,900
積み終了先	1,344,700	2/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,344,400	積数	11,400
非準備先残高	164,100	1日平均	1,600
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,986,300		
準備預金進捗率	99.43% (実績)		77.42% (日数)

2/5のマナターベース		2,716,800	
2/5コール	合計	204,000	無担 83,716 有担 120,284
コール前日増減	計	▲ 325	無担 1,485 有担 ▲ 1,810

2/6の加重平均レート(速報)			2/5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	無担先日付分	有担当日分
0.030 ~0.080 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.135 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.120 (0.077)					0.072 ~0.120 (0.080)	
0.071 ~0.260 (0.121)					0.076 ~0.117 (0.107)	
0.118 (0.118)					0.118 (0.118)	
0.150 (0.150)		0.08-0.12	-		0.076 ~0.170 (0.110)	有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	▲0.002			
		-	▲0.012-▲0.007			
		-	-			

<< 2/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,772,600	前日比	▲ 24,200
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。

<< 6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2兆3,000億円増加の134兆6,000億円(当座預金残高見込みは179兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.068~0.07%、地銀・信託業態から0.07~0.073%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.073%を中心とした出合い。週末要因からか、朝方より地銀業態を中心に積極的な調達が見られた。ターム物は、1Wの期間で大手行による調達が確認された。

<< 6日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは横ばい圏の推移となった。短国アウトライト市場は6M物の入札が実施され、平均落札利回り▲0.0040%、最高落札利回り▲0.0020%と事前予想通り堅調な結果となった。入札後のセカンダリーでは▲0.012~▲0.007%の出合いがみられた。C P市場は10日発行となったことで、鉄鋼業態を中心に発行総額は2,700億円程度に膨らんだ。発行レートは小幅上昇となっていた。

- << 9日の材料 >>
- \*森本日銀審議委員、千葉県金融経済懇談会における挨拶
  - \*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
  - \*米国1月のF R B労働市場情勢指数
  - \*G 20財務省・中央銀行総裁会議(イスタンブール、10日まで)
  - \*預金保険機構借入(12ヶ月程度、2/20借入)

JGB新発10年債	0.340	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	17,648.50	143.88	為替(9時)	117.53-55
						為替(5時)	117.36-38

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	1/30	2/2	2/3	2/4	2/5	2/6
日銀当預残	1,849,300	1,816,100	1,822,700	1,800,800	1,784,100	1,796,800
準備預金残	1,683,200	1,650,600	1,655,200	1,631,300	1,619,400	1,632,700
レート	0.071%	0.071%	0.073%	0.075%	0.076%	0.073%
月中平均	0.07284%	0.07100%	0.07167%	0.07250%	0.07320%	0.07313%

<< オペ情報、入札結果 >>

全店共通	15,000億円	2/10	~ 5/22 (101日間)	応札	3,600億円	落札	3,600億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	6,636億円	2/6	~ 2/9 (3日間)	応札	15億円	落札	15億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	2/10	応札	8,515億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	0.003%	59.3%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	2/10	応札	8,178億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.008%	41.3%	平均利回り較差	0.012%
国債買入	2,400億円	2/10	応札	4,384億円	落札	2,402億円	按分利回り較差	0.002%	8.3%	平均利回り較差	0.013%
国債買入	1,400億円	2/10	応札	3,358億円	落札	1,402億円	按分利回り較差	-0.005%	90.6%	平均利回り較差	0.004%

T-Bill6M 応札24兆481億円 落札3兆2,664億1,000万円(非競争入札:2,335億円) 2/10~8/10 ▲0.0020% 按分89.6994% 平均 ▲0.0040%

「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