

《資金需給》

単位 億円

	1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	金額	金額
銀行券		1,300		1,200		1,000
財政		▲ 4,500		▲ 15,600		▲ 52,000
資金過不足		▲ 3,200		▲ 14,400		▲ 51,000
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		400				
62,564		▲ 500				
国債買現		0				
CP買現		0				
国庫短期証買入						10,000
国庫短期証売却						
国債買入						8,900
CP等買入						
		▲ 300		▲ 100		
貸出支援基金 (成長) 58,484 (増加) 271,714						
被災地支援		3,144				
社債等買入						
ETF買入				200		
国債補完供給						
小計		▲ 400		100		18,900
当増増減		▲ 3,600		▲ 14,300		▲ 32,100

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	2,575,100	前日比	▲ 14,300
O/N	0.03~0.07	T/N	0.03~0.12	S/N	0.03~0.12

無担O/Nは、0.03~0.07%のレンジでの出合いが中心になると見込まれる。

《 1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1兆5,000億円減少の192兆3,000億円(当座預金残高見込みは259兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託・系統・証券業態などから0.04~0.05%での調達希望。立ち上がりは0.05%近辺の出合いが中心。その後徐々に取り上がり、0.06~0.07%のレンジでの出合いが見られた。ターム物は閑散な地合い。

《 1日のオープン市場動向 》

金融政策変更を受けて、現先S/N物は大幅低下した。短国市場は短国買入オペが10,000億円で実施され、平均落札較差▲0.009%・按分利回較差▲0.049%となり、マイナス金利導入後の水準を探る展開となった。CP市場は発行案件に乏しく閑散。発行レートは、水準を探る動きのなか、大幅に低下する結果となった。

《 2日の材料 》

- *1月のマネタリーベース
- *1月実績/2月見込み財政資金対民間収支
- *10年利付国債入札(24,000億円、2/4発行)

《 コール1月の加重平均レート 》

(土日を含む)	無担	0.07071%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07447%	有担	0.03100%

当座預金残高	2,589,400	2/1以降の残り所要積立額	19,000
準備預金残高	2,356,600	2/2以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,910,300	積数	15,800
超過準備	1,910,300	1日平均	1,100
非準備先残高	232,800	積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	2,051,000
準備預金進捗率	99.23% (実績)		54.84% (日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	121.34-36
0.060 ▲ 0.035	17,865.23 346.93	為替(5時)	121.21-23

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	1/25	1/26	1/27	1/28	1/29	2/1
日銀当預残	2,543,500	2,583,100	2,587,400	2,582,800	2,593,000	2,589,400
準備預金残	2,328,500	2,364,400	2,377,200	2,370,000	2,366,300	2,356,600
レート	0.075%	0.079%	0.076%	0.074%	0.066%	0.058%
月中平均	0.07060%	0.07092%	0.07111%	0.07121%	0.07071%	0.05800%

1/29のマネタリーベース		3,587,700	
1/29コール 合計	209,949	無担	68,460
コール前日増減	計 ▲ 13,746	無担 ▲ 11,676	有担 ▲ 2,070

2/1の加重平均レート(速報)				1/29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		
0.040 ~0.075 (0.058)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.010 ~0.125 (0.066)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.049 ~0.121 (0.059)				T/N	0.065 ~0.121 (0.079)			
0.058 (0.058)				S/N				
0.050 ~0.117 (0.065)				1W				
0.310 (0.310)				2W	0.145 (0.145)			
				3W				
		0.01-0.10	-	1M	0.145 (0.145)	有担先日付分		
		0.01-0.10	-	2M				
		0.01-0.10	▲0.20	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.25	1Y				

《 オペ情報、入札結果 》

国短買入	10,000億円	2/3	応札	17,046億円	落札	10,001億円	按分利回り較差	-0.049%	45.6%	平均利回り較差	-0.009%
国債買入	700億円	2/3	応札	1,152億円	落札	701億円	按分利回り較差	-0.090%	37.0%	平均利回り較差	-0.031%
国債買入	4,000億円	2/3	応札	11,425億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	-0.080%	47.4%	平均利回り較差	-0.046%
国債買入	4,200億円	2/3	応札	14,441億円	落札	4,202億円	按分利回り較差	-0.044%	43.0%	平均利回り較差	-0.034%

「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