

2014/2/3(月) <セントラル短資株式会社>

<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
銀行券		1,600	1,500	1,000
財政		▲ 7,900	▲ 32,500	2,000
資金過不足		▲ 6,300	▲ 31,000	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		3,200		1,300
171,772		▲ 5,100		▲ 1,200
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			20,000	
国庫短期証売却				
国債買入			9,100	3,100
CP等買入				
		▲ 100	▲ 100	
貸出支援基金				
(成長) 34,599				
(増加) 50,859				
被災地支援				
3,805				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 2,000	29,000	3,200
当預増減		▲ 8,300	▲ 2,000	6,200

当座預金残高	1,096,600	2/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	990,500		46,900
積み終了先	853,900	2/4以降の残り所要積立額	
超過準備	853,800	積数	39,200
非準預先残高	106,100	1日平均	3,300
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,874,200		
準備預金進捗率	97.91%	(実績)	61.29% (日数)

1/31のマネタリーベース		2,008,800	
1/31コール	合計	171,301	無担 60,663 有担 110,638
コール前日増減	計	▲ 2,538	無担 ▲ 994 有担 ▲ 1,544

2/3 の加重平均レート(速報)				1/31 の加重平均レート(確報)				単位 (%)	
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分	
0.060 ~0.125 (0.074)		0.040 ~0.050 (0.041)		O/N	0.060 ~0.085 (0.071)			0.040 ~0.050 (0.041)	
0.070 ~0.130 (0.085)				T/N		0.070 ~0.120 (0.082)			
0.123 ~0.125 (0.124)				S/N		0.125 (0.125)			
0.095 ~0.170 (0.124)				1W	0.130 (0.130)	0.121 ~0.400 (0.219)			
0.095 ~0.118 (0.107)				2W		0.116 ~0.300 (0.248)			
				3W					
0.118 (0.118)			0.08-0.13	0.0450	1M			有担先日付分	
			0.08-0.13	-	2M				
			0.08-0.13	-	3M				
			-	-	6M				
			-	-	1Y				

<オペ情報、入札結果>

全店共通	8,000億円	2/5	~	5/7 (91日間)	応札 1,280億円	落札 1,280億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	1,100億円	2/5	応札	5,687億円	落札 1,108億円	按分利回り較差	0.001%	35.5%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	2,000億円	2/5	応札	5,990億円	落札 2,004億円	按分利回り較差	-0.024%	62.8%	平均利回り較差	-0.020%
ETF買入	128億円	約定日 2/3								
J-REIT買入	3億円	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	1,094,600	前日比	▲ 2,000
O/N	0.06~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07%前後の出合いが中心となるであろう。

< 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は、前日比1兆円減少の86兆5,000億円(当座預金残高見込は109兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは大手行から0.06%、地銀および信託業態から0.07%近辺の調達希望から始まり、0.07%付近中心の取引からの立ち上がりとなった。出し取り一巡後は地合いが若干軟化し、0.065%付近での散発的な取引で推移。午後は調整程度の取引に終始した。ターム物は、大手行から1W物0.117%、2W~1M物0.118%で調達が見られた。

< 3日のオープン市場動向 >

現先レートS/Nは品薄感が強く低位横ばいで推移した。短国市場は、店頭買いから1M:0.045%の出合いも見られたものの、全体的には動意が乏しく閑散としていた。CP市場は、ノンバンクからまとまった額の発行が実施されたことで、総額は1,800億円程度。発行レートは、発行残高が積み上がっている銘柄において若干上昇したことを除くと、概ね同水準での推移であった。

< 4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、2/6発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、2/19借入)

< コール1月の加重平均レート >

(土日を含む)	無担	0.07184%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07258%	有担	0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.24-25
0.610 ▲ 0.010	14,619.13 ▲ 295.40	為替(5時)	102.12-13

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	1/31	2/3
日銀当預残	1,058,300	1,097,700	1,099,200	1,095,300	1,104,900	1,096,600
準備預金残	962,400	990,300	985,800	989,000	1,000,000	990,500
レート	0.072%	0.070%	0.091%	0.070%	0.071%	0.074%
月中平均	0.07130%	0.07125%	0.07193%	0.07187%	0.07184%	0.07200%