

**<<資金需給>>**

単位 億円

	5日需給速報		6日需給予想		9日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		200	100	1,000		
財政		▲ 16,600	▲ 4,100	▲ 20,000		
資金過不足		▲ 16,400	▲ 4,000	▲ 19,000		
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		
75,199			▲ 10,000	▲ 2,400		
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			
CP等買入						
		▲ 400	▲ 500			
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	300			
国債補充供給						
小計		▲ 300	15,400	▲ 200		
当預増減		▲ 16,700	11,400	▲ 19,200		

当座預金残高	1,784,100	2/5以降の残り所要積立額	19,000
準備預金残高	1,618,400	2/6以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,326,300	積数	16,900
超過準備	1,326,300	1日平均	1,700
非準備先残高	165,700	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	99.14% (実績)		67.74% (日数)

2/4のマネタリーベース		2,733,600	
2/4コール	合計	204,325	無担 82,231 有担 122,094
コール前日増減	計	▲ 1,393	無担 ▲ 141 有担 ▲ 1,252

2/5の加重平均レート(速報)			2/4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
0.060 ~0.135 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.135 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.120 (0.080)					0.072 ~0.130 (0.078)	
0.076 ~0.117 (0.101)					0.117 ~0.250 (0.129)	
0.118 (0.118)					0.076 ~0.340 (0.117)	
0.076 ~0.170 (0.110)		0.08-0.12	-		0.118 ~0.147 (0.122)	有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	▲0.007-0.000		0.117 (0.117)	
		-	▲0.010-▲0.0005			
		-	-			
		-	-			

2/6の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,795,500	前日比	11,400
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。

<< 5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2兆4,000億円減少の132兆3,000億円(当座預金残高見込みは178兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.068~0.07%、地銀・信託業態から0.07~0.072%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.072~0.073%を中心とした出合い。昨日と同様、地銀業態を中心に堅調な調達意欲が見られたことから、1日を通して0.07~0.073%の出合いを中心に底堅く推移した。ターム物は、1W~2Wの期間で大手行による幅広い調達が確認された。

<< 5日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは概ね横ばい圏で推移した。短国アウトライト市場は3M物の入札が実施され、平均落札利回り▲0.0015%、最高落札利回り0.000%と事前予想通りの結果となった。セカンダリー市場では0.000%でまとまった出合いが見られた。CP市場は引き続き閑散で、発行総額は700億円程度にとどまった。CP等買入オペが実施され、前日比で500億円増額でのオファーだったものの、発行レートの上昇から按分レートは横ばいとなった。

- << 6日の材料 >>
- \*1月のマネタリーベースと日本銀行の取引
  - \*12月の景気動向指数速報
  - \*米国1月の雇用統計 \*米国12月の消費者信用残高
  - \*国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、2/10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	0.355	▲ 0.025	日経平均株価(終値)	17,504.62	▲ 174.12	為替(9時)	117.29-31
						為替(5時)	117.31-33

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	1/29	1/30	2/2	2/3	2/4	2/5
日銀当預残	1,836,600	1,849,300	1,816,100	1,822,700	1,800,800	1,784,100
準備預金残	1,663,000	1,683,200	1,650,600	1,655,200	1,631,300	1,618,400
レート	0.071%	0.071%	0.071%	0.073%	0.075%	0.076%
月中平均	0.07297%	0.07284%	0.07100%	0.07167%	0.07250%	0.07320%

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通 8,000億円 2/9 ~ 5/11 (91日間) 応札 2,160億円 落札 2,160億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 CP買入 4,000億円 2/10 応札 13,592億円 落札 3,970億円 按分利回り較差 0.091% 95.9% 平均利回り較差 0.092%  
 T-Bill3M 応札25兆5,965億4,000万円 落札5兆2,317億5,000万円(非競争入札:4,182億円) 2/9~5/12 0.0000% 按分44.8519% 平均 ▲0.0015%  
 30年利付国債(表面利率1.5%) 応札1兆4,716億円 落札5,510億円(I非競争入札:487億円) 2/9~2044/12/20 1.490% 按分42.2279% 平均1.464%  
 ETF買入 327億円 約定日 2/5

「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り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