

《資金需給》

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,200	800	0
財政		▲ 18,700	▲ 53,100	▲ 24,000
資金過不足		▲ 17,500	▲ 52,300	▲ 24,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
62,564				
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			9,000	
CP等買入				
		▲ 100	▲ 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			▲ 100	
ETF買入		200		
国債補充供給	即日	▲ 200	200	
小計		▲ 100	19,000	0
当預増減		▲ 17,600	▲ 33,300	▲ 24,000

《 2/3の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,538,500	前日比	▲ 33,300
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは、0.05~0.07%のレンジでの出合いが中心になると見込まれる。

《 2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2兆8,000億円減少の189兆5,000億円(当座預金残高見込みは257兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、信託・系統業態などから0.055~0.065%、地銀業態から0.055%近辺での調達希望。立ち上がりは0.055~0.065%のレンジでの出合い。一巡後は0.06%の出合いを中心に推移した。ターム物は閑散であった。

《 2日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは下限域での推移。短国市場は様子見姿勢が強く、特段の出合いも見られず閑散であった。CP市場も入札件数・発行額共に少なく、発行総額350億円程度の出合いと閑散。

《 3日の材料 》

- *黒田日銀総裁、きさらぎ会にて講演
- *2月の日銀当座預金増減要因見込み
- *日銀金融政策決定会合議事要旨(12月17、18日開催分)
- *1月の消費動向調査
- *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、2/12借入)

《 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	2,571,800	2/2以降の残り所要積立額	15,800
準備預金残高	2,330,900	2/3以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,886,700	積数	13,700
超過準備	1,886,600	1日平均	1,100
非準備先残高	240,900	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	99.33%	(実績)	58.06%
		(日数)	

JGB新発10年債	0.076	0.016	日経平均株価(終値)	17,750.68	▲ 114.55	為替(9時)	120.85-87
						為替(5時)	120.63-64

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	1/26	1/27	1/28	1/29	2/1	2/2
日銀当預残	2,583,100	2,587,400	2,582,800	2,593,000	2,589,400	2,571,800
準備預金残	2,364,400	2,377,200	2,370,000	2,366,300	2,356,600	2,330,900
レート	0.079%	0.076%	0.074%	0.066%	0.058%	0.061%
月中平均	0.07092%	0.07111%	0.07121%	0.07071%	0.05800%	0.05950%

2/1のマネタリーベース				3,582,700
2/1コール	合計	218,949	無担	78,703
			有担	140,246
コール前日増減	計	9,000	無担	10,243
			有担	▲ 1,243

2/2の加重平均レート(速報)				2/1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		有担当日分
0.010 ~ 0.125 (0.061)	0.030 ~ 0.040 (0.031)					O/N	0.040 ~ 0.075 (0.058)	0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.050 ~ 0.121 (0.066)						T/N		
0.063 ~ 0.065 (0.065)						S/N	0.049 ~ 0.121 (0.059)	
0.060 (0.060)						1W	0.057 ~ 0.058 (0.058)	
0.104 ~ 0.210 (0.105)						2W	0.050 ~ 0.117 (0.065)	
						3W	0.310 (0.310)	
						1M		有担当先日付分
						2M		
						3M		
						6M		
						1Y		

《 オペ情報、入札結果 》

国債補完 8,000億円 2/2 ~ 2/3 (1日間) 応札 98億円 落札 98億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)

国債補完 4,000億円 2/2 ~ 2/3 (1日間) 応札 49億円 落札 49億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 2/4~2/12 (8日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.880%

10年利付国債(表面利率0.3%) 応札6兆8,955億円 落札2兆1,985億円(I非競争入札:1,999億円) 2/4~2025/12/20 0.092% 按分82.3850% 平均0.078%

J-REIT買入 12億円 約定日 2/2

「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