

《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	金額	金額
銀行券		900		500		0
財政		▲ 53,400		▲ 17,200		▲ 2,000
資金過不足		▲ 52,500		▲ 16,700		▲ 2,000
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				8,900
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		
国債補完供給		200				
小計		19,000		100		8,900
当増増減		▲ 33,500		▲ 16,600		6,900

当座預金残高	2,538,300	2/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,298,000		13,700
積み終了先	1,855,800	2/4以降の残り所要積立額	
超過準備	1,855,700	積数	12,400
非準備先残高	240,300	1日平均	1,000
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	99.40%	(実績)	61.29% (日数)

2/2のマナターベース		3,563,900	
2/2コール 合計	229,304	無担	93,861
有担	135,443		
コール前日増減	計	10,355	無担
有担	15,158	有担	▲ 4,803

2/3の加重平均レート(速報)				2/2の加重平均レート(確報)			
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	単位(%)
0.030 ~0.125 (0.064)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.010 ~0.125 (0.061)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.121 (0.069)				T/N			
0.066 ~0.070 (0.067)				S/N	0.050 ~0.130 (0.066)		
				1W	0.063 ~0.065 (0.065)		
				2W	0.060 (0.060)		
				3W	0.104 ~0.160 (0.104)	0.155 ~0.210 (0.173)	
		0.01-0.10	-	1M			
		0.01-0.10	▲0.07	2M			有担先日付分
		0.01-0.10	-	3M			
		-	-	6M			
		-	▲0.26	1Y			

《オペ情報、入札結果》

国債補完	2,195億円	2/3	~	2/4 (1日間)	0億円	0億円	按分	平均	(即)		
国債買入	4,500億円	2/5	応札	12,122億円	落札	4,506億円	按分利回り較差	-0.035%	87.6%	平均利回り較差	-0.032%
国債買入	2,600億円	2/5	応札	8,163億円	落札	2,601億円	按分利回り較差	-0.057%	96.4%	平均利回り較差	-0.050%
国債買入	1,800億円	2/5	応札	6,025億円	落札	1,802億円	按分利回り較差	-0.055%	15.4%	平均利回り較差	-0.041%
交付税特会	1兆500億円	2/12~8/12	応札	5兆7,675億円	落札	1兆500億200万円	0.001%	按分	24.8375%	平均	0.001%
ETF買入	330億円	約定日	2/3								
J-REIT買入	12億円	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	2,521,700	前日比	▲ 16,600
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%のレンジでの出会いが中心になると見込まれる。					

《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みは、前日比3兆8,000億円減少の185兆7,000億円(当座預金残高見込みは253兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、信託・系統業態などから0.06~0.07%近辺、地銀業態から0.05~0.06%近辺での調達希望。立ち上がりは0.06~0.07%近辺での出会い。一巡後は全体的に取り下がり、0.05~0.065%のレンジでの出会いを中心に推移した。タム物はロール案件の取引が散見された。

《3日のオープン市場動向》

現先レートは下限域で推移。短期市場は水準感を探る展開の中、1Yが▲0.26%、2Mが▲0.07%の出会いが見られた程度であった。CP市場は5日発行となり、鉄鋼、建設業態等からまとまった発行が見られたことで、発行総額は1,800億円程度に膨らんだ。発行レートは16日以降の新積み期間にかかる長めの銘柄でレートの低下が顕著であった。

《4日の材料》

- *英中銀MPC結果発表
- *米国12月の製造業新規受注・出荷・在庫
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、2/8発行)
- *流動性供給入札(3,000億円、2/8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%

JGB新発10年債	0.058	▲ 0.018	日経平均株価(終値)	17,191.25	▲ 559.43	為替(9時)	119.84-87
						為替(5時)	119.97-98

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	2/1	2/2	2/3
日銀当預残	2,587,400	2,582,800	2,593,000	2,589,400	2,571,800	2,538,300
準備預金残	2,377,200	2,370,000	2,366,300	2,356,600	2,332,000	2,298,000
レート	0.076%	0.074%	0.066%	0.058%	0.061%	0.064%
月中平均	0.07111%	0.07121%	0.07071%	0.05800%	0.05950%	0.06100%