

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		12日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		500	1,000	0
財政		▲ 21,500	5,100	▲ 3,000
資金過不足		▲ 21,000	6,100	▲ 3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,200		
169,827		▲ 3,200		
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			3,200	9,000
CP等買入		3,900		
		▲ 600	▲ 400	
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		100	100	
国債補完供給				
小計		1,400	22,900	9,000
当預増減		▲ 19,600	29,000	6,000

当座預金残高	1,064,000	2/10以降の残り所要積立額	12,300
準備預金残高	962,900	2/12以降の残り所要積立額	
積み終了先	843,600	積数	6,600
超過準備	843,100	1日平均	1,600
非準備先残高	101,100	積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,883,900
準備預金進捗率	99.65% (実績)		87.10% (日数)

2/7のマナリーベース		1,983,400	
2/7コール	合計	172,818	無担 62,519 有担 110,299
コール前日増減	計	▲ 3,118	無担 ▲ 5,394 有担 2,276

2/10の加重平均レート(速報)				2/7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	有担先日付分
0.060 ~0.145 (0.074)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.055 ~0.145 (0.072)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.070 ~0.125 (0.093)				T/N	0.071 ~0.120 (0.081)		
0.125 (0.125)				S/N	0.125 (0.125)		
0.100 ~0.117 (0.109)				1W	0.116 ~0.400 (0.182)		
0.118 ~0.330 (0.126)				2W	0.170 ~0.330 (0.234)		
0.118 (0.118)				3W			
0.118 ~0.400 (0.125)		0.08-0.13	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.044-0.045	3M			
		-	-	6M			
		-	0.0420	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

社債買入	1,000億円	2/17	応札	1,462億円	落札	1,000億円	按分レート	0.072%	22.1%	平均落札レート	0.093%
国債買入	2,500億円	2/13	応札	7,809億円	落札	2,501億円	按分利回り較差	-0.006%	31.4%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	2,500億円	2/13	応札	10,927億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	-0.003%	40.8%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	4,000億円	2/13	応札	8,811億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	-0.014%	94.9%	平均利回り較差	-0.010%

「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

<< 2/12の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,093,000	前日比	29,000
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。

<< 10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7,000億円減少の85兆2,000億円(当座預金残高見込は106兆5,000億円)。無担O/Nは0.07~0.072%の取引から立ち上がり、大手行から0.06%、地銀および信託から0.07%付近の調達希望。先週末と比べると、地銀勢の調達意欲もやや旺盛で、底堅い地合いとなった印象。出し取り一巡後からは、ビッドサイドの薄い閑散な地合いに転じ、0.06%台での取引を中心に散発的に出合い、本日のマーケットを終了した。ターム物は大手行が2W物および1M物を0.118%で調達した。

<< 10日のオープン市場動向 >>
 現先取引は依然低位横ばい水準での出合い。短国市場は売り意欲に乏しく終日閑散な地合い。3M物で0.044~0.045%の出合いが見られた程度であった。CP発行市場は案件数乏しく、発行総額は500億円程度に止まった。レートの変動要因が特段無く、発行水準は概ね横ばいであった。

<< 12日の材料 >>
 *12月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲4.1%)
 *12月の第3次産業活動指数
 *1月のマネーストック
 *米国 1月の財政収支
 *流動性供給(3,000億円、2/14発行)

JGB新発10年債	0.605	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	14,718.34	255.93	為替(9時)	102.51-52
						為替(5時)	102.19-20

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	2/3	2/4	2/5	2/6	2/7	2/10
日銀当預残	1,096,600	1,094,300	1,098,300	1,073,800	1,083,600	1,064,000
準備預金残	990,800	987,300	993,500	970,500	977,800	962,900
レート	0.074%	0.082%	0.080%	0.079%	0.072%	0.074%
月中平均	0.07200%	0.07450%	0.07560%	0.07617%	0.07478%	0.07464%