

◀資金需給▶

単位 億円

	12日需給速報		13日需給予想	14日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,000	▲ 300	▲ 1,000
財政		3,600	▲ 3,200	65,000
資金過不足		4,600	▲ 3,500	64,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
169,827				
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	9,100	
CP等買入		▲ 400	▲ 200	
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		
国債補完供給				
小計		22,900	8,900	0
当預増減		27,500	5,400	64,000

当座預金残高	1,091,500	2/12以降の残り所要積立額	6,600
準備預金残高	986,100	2/13以降の残り所要積立額	
積み終了先	867,700	積数	4,700
超過準備	867,700	1日平均	1,600
非準備先残高	105,400	積立期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,883,900
準備預金進捗率	99.75% (実績)		90.32% (日数)

2/10のマネタリーベース		1,963,400	
2/10コール 合計	170,806	無担	62,966
有担	107,840		
コール前日増減	計 ▲ 2,012	無担	447
		有担	▲ 2,459

2/12 の加重平均レート(速報)				2/10 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 (0.079)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.060 ~0.145 (0.074)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.070 ~0.120 (0.074)					0.070 ~0.125 (0.093)		
					0.125 (0.125)		
0.117 (0.117)				1W	0.100 ~0.117 (0.108)		
0.118 ~0.180 (0.126)				2W	0.118 ~0.330 (0.122)		
0.077 (0.077)				3W	0.118 (0.118)		
0.160 ~0.305 (0.257)		0.08-0.13	0.0400	1M	0.118 ~0.400 (0.122)		有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.040-0.042	3M			
		-	-	6M			
		-	0.0410	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

米ドル資金供給(固定金利方式) 2/14 ~ 2/21 (7日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率0.570%
 流動性供給 応札7,640億円 2,993億円 2/14 募入最大利回較差0.015% 按分52.2047% 募入平均利回較差0.013%

「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

◀ 2/13の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,096,900	前日比	5,400
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。

◀ 12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1兆4,000億円増加の86兆6,000億円(当座預金残高見込は109兆3,000億円)。無担O/Nは前日の地合いを引き継ぎ、大手行から0.06%、地銀および信託から0.07%付近のビッドから始まり、取引は0.07~0.072%での立ち上がりとなった。出し取り一巡後には地銀、信託業態の調達意欲は総じて減退し、0.06~0.065%で散発的な取引が行われた。午後は調整程度の取引が行われ、本日の取引を終えた。ターム物はロールオーバーの案件が中心となった。

◀ 12日のオープン市場動向 ▶
 現先取引S/Nは依然低水準での取引。短国市場は一部店頭見合いの買いから3M0.040~0.042%の出合いが見られたものの、明日の3M物入札を控え全般的に動意は乏しかった。CP発行市場は15日にかかる取引となり、電機・鉄鋼業態からまとまった額の発行が見られ、総額は1,900億円弱。レート水準は総じて横ばいであった。

◀ 13日の材料 ▶
 *1月の企業物価指数
 *米国12月の企業在庫
 *米国1月の小売売上高
 *国庫短期証券入札(3カ月、57,000億円、2/17発行)

JGB新発10年債	0.610	0.010	日経平均株価(終値)	14,800.06	81.72	為替(9時)	102.52-54
						為替(5時)	102.50-51

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	2/4	2/5	2/6	2/7	2/10	2/12
日銀当預残	1,094,300	1,098,300	1,073,800	1,083,600	1,064,000	1,091,500
準備預金残	987,300	993,500	970,500	977,800	963,400	986,100
レート	0.082%	0.080%	0.079%	0.072%	0.074%	0.079%
月中平均	0.07450%	0.07560%	0.07617%	0.07478%	0.07464%	0.07500%