

<<資金需給>>

単位 億円

	13日需給速報		14日需給予想	17日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 300	1,000
財政		▲ 3,200	63,900	▲ 24,000
資金過不足		▲ 3,300	63,600	▲ 23,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,100
169,827				▲ 4,400
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		9,100		6,000
CP等買入				
		▲ 200	▲ 800	
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				1,000
ETF買入				
国債補完供給				
小計		8,900	▲ 800	4,700
当預増減		5,600	62,800	▲ 18,300

当座預金残高	1,097,100	2/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	985,900		4,700
積み終了先	866,300	2/14以降の残り所要積立額	
超過準備	866,300	積数	2,800
非準備先残高	111,200	1日平均	1,400
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	99.85% (実績)	93.55% (日数)	

2/12のマネタリーベース		1,989,800	
2/12コール	合計	173,441	無担 67,732 有担 105,709
コール前日増減	計	2,635	無担 4,766 有担 ▲ 2,131

2/13 の加重平均レート(速報)				2/12 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	
0.055 ~0.127 (0.077)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N	0.060 ~0.145 (0.079)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.121 (0.076)				T/N		0.070 ~0.120 (0.074)	
				S/N			
0.070 ~0.121 (0.108)				1W		0.117 (0.117)	
0.118 ~0.150 (0.134)				2W		0.118 ~0.180 (0.126)	
				3W		0.077 (0.077)	
0.118 ~0.400 (0.136)		0.08-0.13	-	1M		0.160 ~0.305 (0.257)	有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.040-0.044	3M			
		-	-	6M			
		-	0.0420	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	2/17 ~ 5/15 (87日間)	応札 2,060億円	落札 2,060億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	4,000億円	2/17	応札 10,908億円	落札 4,001億円	按分利回り較差 -0.003%	20.3%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	2,000億円	2/17	応札 5,543億円	落札 2,001億円	按分利回り較差 -0.007%	20.3%	平均利回り較差	-0.002%
T-Bill3M	応札32兆459億円	落札5兆2,458億円(非競争入札:4,541億円)	2/17~5/19	0.0421%	按分64.3961%	平均0.0413%		
ETF買入	123億円	約定日	2/13					
J-REIT買入	3億円	約定日	2/13					

<< 2/14の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,159,900	前日比	62,800
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。

<< 13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5,000億円増加の87兆1,000億円(当座預金残高見込は109兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは0.07~0.072%の取引から立ち上がり、大手行より0.06~0.065%、地銀および信託から0.07%付近のビッドが並ぶ展開。出し取り一巡後は、取り手サイドが限定的となり、ややレート水準が低下。0.06~0.07%で散発的に取引が行われた。午後は0.06%で大手行が調達を行った程度で、閑散とした地合いの中、本日の取引を終えた。ターム物は目立った引き合いに乏しく、薄商いであった。

<< 13日のオープン市場動向 >>
 現先取引は底ばい圏での出合い。短国市場は3M物の入札が実施された。W I 市場では0.04%の出合いが確認されるなか、落札結果は平均利回0.0413%、按分利回0.0421%と事前予想通りの結果。絶対水準の低さからセカンダリーでは同水準での買いは乏しく、0.043~0.044%での出合いが見られるなどやや軟調な展開となった。CP発行市場は複数の石油業態からまとまった額の発行があり、総額は2,000億円程度に達した。残高が積み上がっている銘柄ではレートがやや上昇したが、全体的に見ると概ね横ばいであった。

<< 14日の材料 >>
 *12月のマネタリーサーベイ
 *米国1月の鉱工業生産・設備稼働率
 *米国2月のミシガン大消費者信頼感指数速報
 *5年利付国債入札(27,000億円、2/18発行)

JGB新発10年債	0.600	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	14,534.74	▲ 265.32	為替(9時)	102.46-47
						為替(5時)	102.11-12

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	2/5	2/6	2/7	2/10	2/12	2/13
日銀当預残	1,098,300	1,073,800	1,083,600	1,064,000	1,091,500	1,097,100
準備預金残	993,500	970,500	977,800	963,400	986,500	985,900
レート	0.080%	0.079%	0.072%	0.074%	0.079%	0.077%
月中平均	0.07560%	0.07617%	0.07478%	0.07464%	0.07500%	0.07515%

「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