

◀資金需給▶

単位 億円

	14日需給速報		17日需給予想		18日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300		800		▲ 1,000
財政		63,800		▲ 28,200		▲ 29,000
資金過不足		63,500		▲ 27,400		▲ 30,000
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						20,000
国庫短期証売却						
国債買入				6,100		
CP等買入						
		▲ 800		▲ 700		
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		▲ 800		4,100		20,000
当預増減		62,700		▲ 23,300		▲ 10,000

当座預金残高	1,159,800	2/14以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,050,500		2,800
積み終了先	921,600	2/17以降の残り所要積立額	
超過準備	920,200	積数	967,700
非準備先残高	109,300	1日平均	35,800
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			1,883,900

2月の新所要見込 1,689,700 (一日平均)

2/13のマネタリーベース		1,995,500	
2/13コール	合計	175,836	無担 68,267 有担 107,569
コール前日増減	計	2,395	無担 535 有担 1,860

2/14の加重平均レート(速報)				2/13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
0.055 ~0.145 (0.071)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.055 ~0.127 (0.077)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.070 ~0.125 (0.086)					0.065 ~0.125 (0.077)		
						0.070 ~0.122 (0.111)	
0.117 (0.117)						0.118 ~0.150 (0.134)	
0.140 ~0.300 (0.247)							
0.100 ~0.250 (0.130)		0.08-0.13	-			0.118 ~0.400 (0.136)	有担先日付分
		0.08-0.13	-				
		0.08-0.13	0.040-0.0415				
		-	-				
		-	0.0400				

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	2,000億円	2/14 ~ 2/17 (3日間)	応札 30億円	落札 30億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国短買入	20,000億円	2/18	応札 49,889億円	落札 20,006億円	按分利回り較差 -0.001%	22.6%	平均利回り較差 0.000%

5年利付国債(表面利率0.2%)応札10兆1,963億円落札2兆5,023億円(I非競争入札:1,956億円) 2/18~2018/12/20 0.187%按分85.6126%平均0.185%

ETF買入 123億円 約定日 2/14

◀ 2/17の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,136,500	前日比	▲ 23,300
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。

◀ 14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4兆5,000億円増加の91兆6,000億円(当座預金残高見込は116兆円)。無担O/Nは大手行から0.06~0.065%、地銀および信託業態から0.07%付近のビッドで、0.07~0.071%中心の取引から始まった。本日は積み最終日ながら、年金定時払いにより地銀業態を中心に資金余剰感は強く、落ち着いた水準からの立ち上がりとなった。出し取り一巡後は0.065%前後の散発的な取引で軟調に推移。午後は一部調整の動きが見られた程度で特段の動意はなく、マーケットを終了した。ターム物は目立った出合いは見られず、閑散であった。

◀ 14日のオープン市場動向 ▶  
 現先取引S/Nは底ばい圏で推移。短国市場は短国買入オペが実施され、利回較差は平均±0.000%、按分△0.001%とマーケットの品薄感を反映した結果となった。オペアナウンス直後に3M物で0.040%のまとまった出合いが確認されたが、その後は売り物が出にくく、閑散な地合いへと推移した。CP発行市場は案件数が少なく総額800億円程度に止まった。レート水準は概ね横ばいであった。

- ◀ 17日の材料 ▶
- \*10-12月期のGDP1次速報(市場予想:前期比年率+2.8%)
  - \*12月の石油等消費動態統計
  - \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、18日まで)
  - \*米国休場(プレジデントデー)
  - \*国庫短期証券入札(1年、25,000億円、2/20発行)

◀コール1月積み期間分の加重平均レート▶			
(土日を含む)	無担	0.07352%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07438%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	0.590	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	14,313.03	▲ 221.71	為替(9時)	102.18-19
						為替(5時)	101.82-84

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	2/6	2/7	2/10	2/12	2/13	2/14
日銀当預残	1,073,800	1,083,600	1,064,000	1,091,500	1,097,100	1,159,800
準備預金残	970,500	977,800	963,400	986,500	986,200	1,050,500
レート	0.079%	0.072%	0.074%	0.079%	0.077%	0.071%
月中平均	0.07617%	0.07478%	0.07464%	0.07500%	0.07515%	0.07438%

「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