

<<資金需給>>

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想		19日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		800	500	▲ 1,000		
財政		▲ 29,500	▲ 24,600	2,000		
資金過不足		▲ 28,700	▲ 24,100	1,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		2,100		1,300		
167,512		▲ 4,400		▲ 2,900		
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		9,000		
CP等買入						
		▲ 700		▲ 100		
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			100			
国債補完供給						
小計		4,100	20,000	7,400		
当預増減		▲ 24,600	▲ 4,100	8,400		

当座預金残高	1,135,200	2/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,017,300		967,700
積み終了先	639,400	2/18以降の残り所要積立額	
超過準備	381,300	積数	463,700
非準備先残高	117,900	1日平均	17,800
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)			1,689,700
準備預金進捗率	72.56%	(実績)	7.14% (日数)

2/14のマネタリーベース		2,058,500	
2/14コール	合計	170,100	無担 63,251 有担 106,849
コール前日増減	計	▲ 5,736	無担 ▲ 5,016 有担 ▲ 720

2/17の加重平均レート(速報)			2/14の加重平均レート(確報)			単位(%)		
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.055 ~0.145 (0.075)	0.040 ~0.050 (0.041)		O/N 0.055 ~0.145 (0.071)		0.040 ~0.050 (0.041)			
0.070 ~0.125 (0.086)			T/N	0.070 ~0.125 (0.086)				
0.125 (0.125)			S/N					
0.116 ~0.400 (0.161)			1W	0.117 (0.117)				
0.115 (0.115)			2W	0.118 ~0.300 (0.195)				
			3W					
0.160 ~0.300 (0.230)		0.08-0.13	1M	0.100 ~0.250 (0.130)				有担先日付分
		0.08-0.13	2M					
		0.08-0.13	3M					
		-	6M					
		-	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	2/19 ~ 5/19 (89日間)	応札	1,290億円	落札	1,290億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
CP買入	4,000億円	2/20	応札	7,545億円	落札	3,520億円	按分レート	0.086%	16.3%	平均落札レート	0.090%
国債買入	2,500億円	2/19	応札	9,959億円	落札	2,506億円	按分利回り較差	-0.003%	50.3%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	2,500億円	2/19	応札	10,740億円	落札	2,504億円	按分利回り較差	0.005%	63.1%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	2/19	応札	12,528億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	0.005%	29.2%	平均利回り較差	0.006%

T-Bill1Y 応札12兆7,479億円 落札2兆3,467億2,000万円(非競争入札:1,532億5,000万円) 2/20~2015/2/20 0.0390%按分82.1480%平均0.0390%

「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

<< 2/18の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,131,100	前日比	▲ 4,100
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ろう。

<< 17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、前営業日比2兆1,000億円減少の89兆5,000億円(当座預金残高見込は113兆7,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06%、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。積み序盤ながら、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、一日の取引を終了した。ターム物はロールオーバー案件中心の取引となった。共通担保オペについては、固定金利方式で3M物が8,000億円オファーされたが、応札総額1,290億円に留まり、札割れとなった。

<< 17日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばいで推移。短国市場は1Y物の入札が実施され、WI取引で0.040~0.041%の出合いが見られたが、平均・最高落札利回共に0.0390%と事前予想よりやや強めの結果。セカンダリーでは0.030~0.035%の出合いも少額見られたが、落札先が偏ったこともあり、その後は様子見閑散。CP発行市場は900億円程度の出合いと閑散。CP等買入オペは平均落札利回0.09%、按分落札利回0.086%と一部銘柄の応札ニーズにより前回比で上昇した。

<< 18日の材料 >>
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)
 *黒田日銀総裁、定例会見
 *英国1月の消費者物価指数

<<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	0.600	0.010	日経平均株価(終値)	14,393.11	80.08	為替(9時)	101.53-54
						為替(5時)	101.75-76

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	2/7	2/10	2/12	2/13	2/14	2/17
日銀当預残	1,083,600	1,064,000	1,091,500	1,097,100	1,159,800	1,135,200
準備預金残	977,800	963,400	986,500	986,200	1,050,500	1,017,300
レート	0.072%	0.074%	0.079%	0.077%	0.071%	0.075%
月中平均	0.07478%	0.07464%	0.07500%	0.07515%	0.07438%	0.07441%