

《資金需給》

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想	21日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 1,400	▲ 1,000
財政		▲ 300	▲ 7,000	▲ 13,000
資金過不足		▲ 700	▲ 8,400	▲ 14,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,300		
165,942		▲ 2,900		
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		9,000		
CP等買入			3,500	
		▲ 100	▲ 600	
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			▲ 100	
ETF買入				
国債補充供給				
小計		7,300	2,800	0
当預増減		6,600	▲ 5,600	▲ 14,000

《 2/20の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,132,500	前日比	▲ 5,600
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。

《 19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1兆2,000億円増加の89兆8,000億円(当座預金残高見込は113兆8,000億円)。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。昨日同様、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。午後に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。

《 19日のオープン市場動向 》
 現先レートは若干の強含み。短国アウトライト市場は3Mの入札を控え様子見閑散姿勢の中、散発的な出合いが見られた程度。CP市場は件数少ない中、鉄鋼・ノンバンク業態の大型発行を中心に1,200億円程度の出合い。引き続き動意の乏しい展開であった。

《 20日の材料 》

- *1月の貿易統計
- *森本日銀審議委員、和歌山県金融経済懇談会にて講演
- *米国1月の消費者物価指数
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、2/24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%

当座預金残高	1,138,100	2/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,025,000		277,500
積み終了先	855,200	2/20以降の残り所要積立額	
超過準備	843,000	積数	226,500
非準備先残高	113,100	1日平均	9,400
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	86.60% (実績)	14.29% (日数)	

JGB新発10年債	0.605	0.005	日経平均株価(終値)	14,766.53	▲ 76.71	為替(9時)	102.31-32
						為替(5時)	102.05-07

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	2/12	2/13	2/14	2/17	2/18	2/19
日銀当預残	1,091,500	1,097,100	1,159,800	1,135,200	1,131,500	1,138,100
準備預金残	986,500	986,200	1,050,500	1,017,300	1,025,800	1,025,000
レート	0.079%	0.077%	0.071%	0.075%	0.071%	0.079%
月中平均	0.07500%	0.07515%	0.07438%	0.07441%	0.07422%	0.07447%

2/19の加重平均レート(速報)				2/18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	短国	無担当日分		無担先日付分	有担当日分
0.050 ~0.145 (0.079)	0.040 ~0.050 (0.041)					O/N	0.060 ~0.130 (0.071)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.070 ~0.120 (0.080)						T/N		0.070 ~0.130 (0.089)	
						S/N		0.125 (0.125)	
0.117 (0.117)						1W		0.124 ~0.200 (0.162)	
0.118 ~0.180 (0.139)						2W		0.340 (0.340)	
0.150 (0.150)						3W			
0.205 (0.205)				0.08-0.13	-	1M		0.155 (0.155)	有担先日付分
				0.08-0.13	0.0450	2M			
				0.08-0.13	-	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

《 オペ情報、入札結果 》

米ドル資金供給(固定金利方式) 2/21~2/27 (6日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.560%
 20年利付国債(表面利率1.6%) 応札4兆296億円 落札1兆968億円(I非競争入札:1,024億円) 2/21~2033/12/20 1.469% 按分52.1463% 平均1.459%
 交付税特会 1兆500億円 2/28~8/27 応札2兆4,360億円 落札1兆500億円 0.100% 按分78.0898% 平均0.098%
 ETF買入 123億円 約定日 2/19

「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録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