

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		12日需給予想		13日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		300	300	▲1,000		
財政		▲9,000	▲6,200	69,000		
資金過不足		▲8,700	▲5,900	68,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		3,600		3,900		
77,497		▲4,700		▲4,900		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入			25,000			
国庫短期証売却						
国債買入		12,300	4,700			
CP等買入		4,000				
		▲600	▲300			
貸出支援基金 (成長) 44,583 (増加) 189,789						
被災地支援						
3,252						
社債等買入						
ETF買入		200				
国債補完供給						
小計		14,800	29,400	▲1,000		
当増減		6,100	23,500	67,000		

<< 2/12の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,802,200	前日比	23,500
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.07%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 10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みは、前日比8,000億円増加の133兆1,000億円(当座預金残高見込みは177兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.068~0.07%、地銀・信託から0.07~0.073%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.073%近辺の出合いが中心となった。一巡後は若干取り下がり、0.07~0.071%の出合いで推移した。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<< 10日のオープン市場動向 >>
 現先取引S/Nは横ばいで推移した。短国市場は6M物で▲0.010%の出合いが見られた程度で、全般的に閑散であった。CP発行市場は15日にかかる取引となり、電機・建設・鉄鋼業態からまとまった額の案件が複数見られ、発行総額は2,000億円弱に膨らんだ。高水準の市場残高を背景に、レート水準は業態問わず若干上昇となった。

<< 11日の材料 >>
 *佐藤日銀審議委員、日本証券サミットにて講演(ロンドン)
 *米国1月の財政収支

<< 12日の材料 >>
 *12月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+2.4%)
 *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ヵ月、57,000億円、2/16発行)

当座預金残高	1,778,700	2/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,614,300		3,200
積み終了先	1,329,200	2/12以降の残り所要積立額	
超過準備	1,328,900	積数	1,600
非準備先残高	164,400	1日平均	400
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	1,986,300		
準備預金進捗率	99.92% (実績)	87.10% (日数)	

JGB新発10年債	0.390	0.035	日経平均株価(終値)	17,652.68	▲59.25	為替(9時)	118.59-60
						為替(5時)	118.72-74

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	2/3	2/4	2/5	2/6	2/9	2/10
日銀当座預金	1,822,700	1,800,800	1,784,100	1,796,800	1,772,600	1,778,700
準備預金残	1,655,200	1,631,300	1,619,400	1,634,100	1,613,700	1,614,300
レート	0.073%	0.075%	0.076%	0.073%	0.081%	0.074%
月中平均	0.07167%	0.07250%	0.07320%	0.07313%	0.07400%	0.07400%

2/9のマネタリーベース				2,704,200
2/9コール	合計	205,645	無担	83,854
			有担	121,791
コール前日増減	計	4,218	無担	2,630
			有担	1,588

2/10の加重平均レート(速報)				2/9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
0.060 ~0.125 (0.074)	0.030	~0.040	(0.031)			0.060 ~0.130 (0.081)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.073 ~0.075 (0.073)							0.073 ~0.123 (0.078)		
0.117 (0.117)							0.117 (0.117)		
							0.118 ~0.310 (0.173)		
0.200 (0.200)				0.08-0.12	-			0.145 (0.145)	有担先日付分
				0.08-0.12	-				
				0.08-0.12	-			0.260 (0.260)	
				-	▲0.010				
				-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 15,000億円 2/13 ~ 5/26 (102日間) 応札 3,860億円 落札 3,860億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 国債補完 2,000億円 2/10 ~ 2/12 (2日間) 0億円 0億円 0% 按分 平均 (即)

米ドル資金供給(固定金利方式) 2/12~2/20 (8日間) 応札なし 貸付利率 0.630%
 流動性供給 応札 6,154億円 落札 2,997億円 2/13 募入最大利回較差 0.040% 按分 78.0000% 募入平均利回較差 0.028%
 ETF買入 327億円 約定日 2/10
 J-REIT買入 12億円 約定日 2/10

「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