

<<資金需給>>

単位 億円

	13日需給速報 即日 金額	16日需給予想 金額	17日当社予想 金額
銀行券	200	1,100	0
財政	64,700	▲ 32,200	▲ 29,000
資金過不足	64,900	▲ 31,100	▲ 29,000
貸出			
売出手形	0		
本店共通	0		
全店共通	0		
共通(固定)	3,900	1,800	4,700
76,447	▲ 4,900	▲ 3,400	▲ 12,700
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		8,000	
CP等買入			
	▲ 400	▲ 800	
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		▲ 100	
ETF買入	600	300	
国債補完供給	▲ 300	300	
小計	▲ 1,100	6,100	12,000
当預増減	63,800	▲ 25,000	▲ 17,000

当座預金残高	1,864,100	2/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,684,500		1,300
積み終了先	1,385,100	2/16以降の残り所要積立額	
超過準備	1,384,700	積数	1,776,900
非準預先残高	179,600	1日平均	63,500
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)			1,986,300

2月の新所要見込 **63,500** (一日平均)

2/12のマナターベース		2,731,400
2/12コール合計	202,681 無担	81,219 有担 121,462
コール前日増減	計 1,756 無担	2,252 有担 ▲ 496

2/13の加重平均レート(速報)			2/12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	
0.060 ~0.125 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)		0.050 ~0.130 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.071 ~0.074 (0.073)				0.073 ~0.080 (0.074)		
				0.125 (0.125)		
0.071 ~0.260 (0.137)			0.122 (0.122)	0.117 ~0.130 (0.117)		
				0.160 (0.160)		
	0.08-0.12	-				有担先日付分
	0.08-0.12	-				
	0.08-0.12	0-0.005				
	-	▲0.007				
	-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	2/17 ~ 5/29 (101日間)	応札 4,711億円	落札 4,711億円	0.100%	全取	平均 0.100% (固定)
国債補完	2,000億円	2/13 ~ 2/16 (3日間)	応札 275億円	落札 275億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国短買入	20,000億円	2/17	応札 49,744億円	落札 20,002億円	按分利回り較差 0.002%	87.6%	平均利回り較差 0.003%

5年利付国債(表面利率0.1%) 応札8兆779億円 落札2兆4,587億円(I非競争入札:2,403億円) 2/17~2019/12/20 0.131% 按分73.6413% 平均0.122%

「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

<< 2/16の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,839,100	前日比	▲ 25,000
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。

<< 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みは、前日比5兆1,000億円増加の140兆1,000億円(当座預金残高見込みは186兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.068~0.07%、地銀・信託から0.07~0.072%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.072%近辺の出合いが中心となった。積み最終日であったが、年金定時払いの影響で資金余剰地合いとなり、昨日までと比べ調達意欲はやや減退した。一巡後は、0.07~0.071%が出合いの中心となった。ターム物は、閑散な地合いであった。本日の共通担保資金供給オペは、3M・1兆5,000億円のオファーに対し、応札額4,711億円(期落ち額12,710億円)の札割れとなった。17日時点での同オペ残高は66,829億円と7兆円台を下回ることとなった。

<< 13日のオープン市場動向 >>
 現先取引S/Nは短国買入オペの通知を契機にやや低下した。短国市場では同オペが20,000億円で実施され、各按分利回り較差は平均+0.003%、按分+0.002%と小甘い結果となった。CP発行市場は案件が数件にとどまり、発行総額は300億円程度であった。消極的な購入姿勢が続いており、レート水準は昨日と同様、0.10%台が中心となっていた。

<< 16日の材料 >>
 *10-12月期のGDP1次速報(市場予想:前期比年率+3.7%)
 *12月の石油等消費動態統計
 *米国祝日(Presidents' Day)

<<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	0.07394%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07450%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.420	0.025	日経平均株価(終値)	17,913.36	▲ 66.36	為替(9時)	118.92-94
						為替(5時)	118.87-89

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	2/9	2/10	2/12	2/13
日銀当預残	1,784,100	1,796,800	1,772,600	1,778,700	1,800,300	1,864,100
準備預金残	1,619,400	1,634,100	1,613,700	1,617,600	1,635,600	1,684,500
レート	0.076%	0.073%	0.081%	0.074%	0.074%	0.073%
月中平均	0.07320%	0.07313%	0.07400%	0.07400%	0.07400%	0.07380%