

<<資金需給>>

単位 億円

	18日需給速報		19日需給予想		20日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 1,000	▲ 2,000		
財政		▲ 600	▲ 12,900	▲ 16,000		
資金過不足		▲ 1,000	▲ 13,900	▲ 18,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					11,800	
66,829					▲ 12,800	
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		12,000				
CP等買入					4,000	
		▲ 200	▲ 200			
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		1,000				
ETF買入		200				
国債補充供給		200				
小計		13,200	▲ 200		3,000	
当預増減		12,200	▲ 14,100		▲ 15,000	

当座預金残高	1,843,100	2/18以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,679,900		271,800
積み終了先	1,314,300	2/19以降の残り所要積立額	
超過準備	1,299,100	積数	189,000
非準備先残高	163,200	1日平均	7,600
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,776,900		
準備預金進捗率	89.36% (実績)	10.71%	(日数)

2/17のマナターベース		2,760,800	
2/17コール合計	211,478	無担	83,766
コール前日増減	計	4,547	無担
		2,848	有担
			1,699

2/18の加重平均レート(速報)				2/17の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分	
0.050 ~0.130 (0.077)	0.030	~0.040 (0.031)		0.060 ~0.128 (0.079)			0.030	~0.040 (0.031)	
0.071 ~0.125 (0.090)						0.071 ~0.125 (0.082)			
0.080 ~0.125 (0.114)						0.110 (0.110)			
0.103 ~0.117 (0.105)									
0.340 (0.340)						0.200 ~0.310 (0.218)			
0.118 ~0.150 (0.119)		0.08-0.12	-	1M				有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12	0.0025-0.005	3M					
		-	-	6M					
		-	▲0.005	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 15,000億円 2/20 ~ 6/2 (102日間) 応札 11,800億円 落札 11,800億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
米ドル資金供給(固定金利方式) 2/20~2/26 (6日間) 応札 300万ドル 落札 300万ドル 貸付利率 0.620%

<<日銀金融政策決定会合・結果>>

- ・マナターベースが、年間約80兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(賛成8反対1)
- ・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)
- ① 長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。買入れの平均残存期間は7年~10年程度とする。
- ② ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約3兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
- ③ CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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

<< 2/19の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,829,000	前日比	▲ 14,100
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

試し取りにより加重平均は高めとなることが予想されるが、出会いの中心は0.07%台前半となると見込まれる。

<< 18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、137兆9,000億円(当座預金残高見込みは184兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.073%、大手行からは0.068%での調達希望で始まり、出会いの中心は0.072~0.073%となった。また、一部業態が試し取りを行ったため、実勢よりも高めのレートでの出会いが見られた。一巡後も0.07%台前半での取引が散見される程度で取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1M物0.118%で調達を行った。本日の共通担保資金供給オペは、3M物1兆5,000億円のオファーに対し、落札額1兆1,800億円(期落ち額1兆2,800億円)の札割れとなった。金融政策決定会合では、金融政策の現状維持が決定された。

<< 18日のオープン市場動向 >>
現先S/N物は横ばい圏での動きとなった。短国市場は、3M0.005%でまとまった出会いがみられ、その後0.0025%まで買い進まれた。CP市場では償還総額3,200億円程度に対し、発行総額は2,600億円程度となった。発行レートは、前回比ほぼ横ばいで決着する銘柄が多く見られた。

- << 19日の材料 >>**
- *12月の景気動向指数改訂状況
 - *1月の貿易統計
 - *日銀金融経済月報
 - *月例経済報告
 - *国庫短期証券入札(3ヵ月、57,000億円、2/23発行)
 - *流動性供給入札(4,000億円、2/23発行)
 - *交付税特別会計借入(10,500億円、2/27借入)

<<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		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.415	0.025	18,199.17	212.08	119.20-21	
				119.17-18	

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	2/10	2/12	2/13	2/16	2/17	2/18
日銀当預残	1,778,700	1,800,300	1,864,100	1,838,500	1,830,900	1,843,100
準備預金残	1,617,600	1,635,600	1,687,100	1,671,100	1,664,500	1,679,900
レート	0.074%	0.074%	0.073%	0.075%	0.079%	0.077%
月中平均	0.07400%	0.07400%	0.07380%	0.07388%	0.07418%	0.07433%

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