

<<資金需給>>

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想	23日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,100	▲ 1,300	0
財政		▲ 12,500	▲ 20,100	▲ 18,000
資金過不足		▲ 13,600	▲ 21,400	▲ 18,000
貸出			▲ 100	
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			11,800	2,500
66,829			▲ 12,800	▲ 2,700
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				
CP等買入		▲ 200	▲ 800	4,000
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				
国債補充供給				
小計		▲ 200	2,100	▲ 200
当預増減		▲ 13,800	▲ 19,300	▲ 18,200

当座預金残高	1,829,300	2/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,657,900		189,000
積み終了先	1,316,400	2/20以降の残り所要積立額	
超過準備	1,310,200	積数	140,400
非準備先残高	171,400	1日平均	5,900
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	92.10%	(実績)	14.29% (日数)

2/18のマナターベース		2,773,400	
2/18コール	合計	208,344	無担 82,281 有担 126,063
コール前日増減	計	▲ 3,134	無担 ▲ 1,485 有担 ▲ 1,649

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 ~0.130 (0.082)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.130 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.074 ~0.120 (0.088)					0.071 ~0.125 (0.090)	
0.117 (0.117)					0.080 ~0.125 (0.114)	
0.115 ~0.118 (0.118)					0.103 ~0.117 (0.105)	
0.118 (0.118)					0.340 (0.340)	
0.118 ~0.120 (0.119)		0.08-0.12	-		0.118 ~0.150 (0.118)	有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	0.001-0.009		0.118 (0.118)	
		-	▲0.018-▲0.019			
		-	▲0.01			

<< 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	1,810,000	前日比	▲ 19,300
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%台前半での出合いが中心になると見込まれる。

<< 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みは、135兆4,000億円(当座預金残高見込みは182兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.073%、都銀からは0.07%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.073%と昨日よりもやや強めの立ち上がりとなった。また、一部業態が試し取りを行ったため、加重平均が上昇した。一巡後は調達レートが若干低下し、0.07%での出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物0.117%、2W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8,000億円のオフアーに対し、落札額2,451億円(期落ち額2,650億円)の札割れとなった。

<< 19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。短国市場では3M物入札(514回)が実施された。入札結果は平均落札利回り0.0036% 按分落札利回り0.006%と事前の予想通り、需給を反映した小甘い結果となった。CP市場では、ノンバンク業態から1,000億程度の大型発行案件もみられたものの、発行案件が少なく、発行量は1,600億円程度(同償還総額1,100億円程度)となった。発行レートは小幅ながら上昇した。

<< 20日の材料 >>
 *特にありません

<<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	0.390	▲ 0.025	日経平均株価(終値)	18,264.79	65.62	為替(9時)	118.72-75
						為替(5時)	118.70-72

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	2/16	2/17	2/18	2/19
日銀当預残	1,800,300	1,864,100	1,838,500	1,830,900	1,843,100	1,829,300
準備預金残	1,635,600	1,687,100	1,671,100	1,664,500	1,682,500	1,657,900
レート	0.074%	0.073%	0.075%	0.079%	0.077%	0.082%
月中平均	0.07400%	0.07380%	0.07388%	0.07418%	0.07433%	0.07474%

<<オペ情報、入札結果>>
 全店共通 8,000億円 2/23 ~ 5/25 (91日間) 応札 2,451億円 落札 2,451億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札27兆1,938億円 落札5兆2,433億4,000万円(非競争入札:4,566億円) 2/23~5/25 0.0060% 按分37.5335% 平均0.0036%
 流動性供給 応札 1兆3,205億円 落札3,998億円 2/23 募入最大利回較差 ▲0.023% 按分 3.2000% 募入平均利回較差 ▲0.030%
 交付税特会 1兆500億円 2/27~8/27 応札 3兆4,294億円 落札 1兆500億円 0.088% 按分 70.6132% 平均 0.087%
 J-REIT買入 12億円 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