

<<資金需給>>

単位 億円

	20日需給速報		23日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300	▲ 100	0
財政		▲ 19,800	▲ 17,900	▲ 1,000
資金過不足		▲ 21,100	▲ 18,000	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		11,800	2,500	
65,829		▲ 12,800	▲ 2,700	
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				11,800
CP等買入		4,000	▲ 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				
ETF買入			200	
国債補完供給				
小計		2,200	▲ 400	36,800
当預増減		▲ 18,900	▲ 18,400	35,800

当座預金残高	1,810,400	2/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,644,600		140,400
積み終了先	1,331,400	2/23以降の残り所要積立額	
超過準備	1,323,100	積数	67,400
非準備先残高	165,800	1日平均	3,200
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	96.21% (実績)	25.00% (日数)	

2/19のマナリーベース				2,760,700		
2/19コール	合計	204,556	無担	75,969	有担	128,587
コール前日増減	計	▲ 3,788	無担	▲ 6,312	有担	2,524

2/20の加重平均レート(速報)				2/19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		有担当日分	
0.060 ~0.130 (0.075)	0.030	~0.040	(0.031)			0.050 ~0.130 (0.082)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.073 ~0.125 (0.086)							0.074 ~0.120 (0.088)		
0.070 ~0.260 (0.129)							0.117 (0.117)		
0.118 (0.118)							0.115 ~0.118 (0.118)		
							0.118 (0.118)		
0.118 (0.118)				0.08~0.12	-		0.118 ~0.120 (0.119)		有担当日付分
				0.08~0.12	-				
				0.08~0.12	0.000~0.009				
				-	-				
				-	▲0.005				

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	25,000億円	2/24	応札	46,457億円	落札	25,002億円	按分利回り較差	-0.001%	2.8%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	2/24	応札	9,693億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	-0.008%	10.9%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	4,000億円	2/24	応札	6,041億円	落札	4,000億円	按分利回り較差	-0.009%	8.0%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	2,400億円	2/24	応札	4,743億円	落札	2,401億円	按分利回り較差	-0.015%	73.3%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	1,400億円	2/24	応札	5,010億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	-0.012%	43.8%	平均利回り較差	-0.008%

被災地支援(第46回) 2/27~2016/2/26 (364日間) 貸付予定総額 0億円 貸付利率 0.10%

J-REIT買入 12億円 約定日 2/23

「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

<< 2/23の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,792,000	前日比	▲ 18,400
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。

<< 20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、135兆1,000億円(当座預金残高見込みは181兆円)。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0.073~0.074%と昨日よりもやや強めの立ち上がりとなった。一巡後はビッドが薄くなり、0.07%近辺での出合いが散見される程度で今週の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<< 20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物が商いを伴って0.009%から0.007%へと買い進まれていたこともあり、短国買入オペは按分利回り較差▲0.001% 平均利回り較差+0.002%と落ち着いた結果となった。CP市場は、償還総額1,100億円程度に対し発行総額は1,000億円程度であった。発行レートは概ね横ばいの状態が続いていた。

<< 23日の材料 >>
*金融政策決定会合議事要旨(1月20、21日開催分)
*米国1月の中古住宅販売

JGB新発10年債	0.390	0.000	日経平均株価(終値)	18,332.30	67.51	為替(9時)	118.98-00
						為替(5時)	118.82-84

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	2/13	2/16	2/17	2/18	2/19	2/20
日銀当預残	1,864,100	1,838,500	1,830,900	1,843,100	1,829,300	1,810,400
準備預金残	1,687,100	1,671,100	1,664,500	1,682,500	1,659,000	1,644,600
レート	0.073%	0.075%	0.079%	0.077%	0.082%	0.075%
月中平均	0.07380%	0.07388%	0.07418%	0.07433%	0.07474%	0.07477%