

《資金需給》

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想		17日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		900		400		0
財政		44,500		▲ 500		▲ 1,000
資金過不足		45,400		▲ 100		▲ 1,000
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		59,740		▲ 1,100		
国債買現		0				
CP買現		0				
国庫短期証買入				17,500		
国庫短期証売却						
国債買入		9,700				12,700
CP等買入				▲ 100		
貸出支援基金(成長)		58,484				
(増加)		271,714				
被災地支援		3,144				
社債等買入						
ETF買入				400		
国債補完供給		200				
小計		8,200		17,800		12,700
当増増減		53,600		17,700		11,700

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	2,582,300	前日比	17,700
O/N	0.001~0.075	T/N	0.001~0.12	S/N	0.001~0.12

無担O/Nは、0.001~0.075%のレンジでの出合いが中心になると見込まれる。

《15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3兆6,000億円増加の187兆4,000億円(当座預金残高見込みは256兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、大手行・信託・地銀業態などから0.07%近辺の調達希望で始まり0.07~0.075%の出合いが中心。一巡後は0.04~0.06%台まで取り下がる動きとなった。また一部で試し取りと見られる0.125%の出合いが見られる中で本日の取引を終えた。ターム物は1~2Wの期間で0~0.001%の出合いが散見された。

《15日のオープン市場動向》

現先レートS/Nは弱含みな推移となった。短国市場は、明日移行の状況が不透明なため閑散とした地合いとなった。セカンダリーは3M物で▲0.11%での出合いが見られた程度であった。CP市場は、償還額が小額であったこともあり、発行額は1,000億円弱と、さほど膨らまなかった。発行レートは概ね横ばい圏で推移し、期末越えを含めた長いタームの銘柄では強めの買いが入る地合いが継続した。

《16日の材料》

- *英国1月の消費者物価指数
- *20年利付国債入札(12,000億円、2/18発行)

《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	0.07113%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07115%	有担	0.03100%

当座預金残高	2,564,600	2/15以降の残り所要積立額	600
準備預金残高	2,332,700	2/16以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,882,100	積数	1,900,000
超過準備	1,881,500	1日平均	65,500
非準預先残高	231,900	積み期間(1/16~2/15)の所要準備額(積数)	2,060,000
2月の新所要見込		65,500	(一日平均)

JGB新発10年債	0.085	0.010	日経平均株価(終値)	16,022.58	1,069.97	為替(9時)	113.67-69
						為替(5時)	113.76-78

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	2/8	2/9	2/10	2/12	2/15
日銀当預残	2,533,800	2,522,300	2,547,000	2,519,700	2,511,000	2,564,600
準備預金残	2,290,600	2,274,700	2,302,100	2,285,000	2,273,000	2,332,700
レート	0.068%	0.072%	0.073%	0.072%	0.071%	0.074%
月中平均	0.06471%	0.06563%	0.06644%	0.06745%	0.06821%	0.06860%

2/12のマナターベース				3,500,300			
2/12コール	合計	173,070	無担	76,467	有担	96,603	
コール前日増減	計	▲ 2,219	無担	2,107	有担	▲ 4,326	

2/15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	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	有担先日付分		
0.010 ~0.125 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.010 ~0.125 (0.071)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.030 ~0.040 (0.036)				T/N		0.050 ~0.121 (0.074)			
0.050 ~0.120 (0.085)				S/N		0.001 ~0.120 (0.007)			
0.000 ~0.150 (0.016)				1W		0.080 ~0.150 (0.124)			
0.000 ~0.280 (0.043)				2W		0.001 ~0.150 (0.011)			
				3W		0.001 ~0.150 (0.011)			
		0.01-0.10	-	1M		0.000 ~0.150 (0.048)			有担先日付分
		0.01-0.10	-	2M					
		0.01-0.10	▲0.11	3M					
		-	-	6M					
		-	-	1Y					

《オペ情報、入札結果》

国債補完	4,000億円	2/15	~ 2/16 (1日間)	応札	1億円	落札	1億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	2/17	応札	13,721億円	落札	4,011億円	按分利回り較差	0.016%	69.6%	平均利回り較差	0.020%
国債買入	4,200億円	2/17	応札	17,251億円	落札	4,202億円	按分利回り較差	0.023%	1.9%	平均利回り較差	0.027%
国債買入	4,500億円	2/17	応札	8,417億円	落札	4,502億円	按分利回り較差	0.008%	87.4%	平均利回り較差	0.014%

「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り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