

≪資金需給≫

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想		19日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 800	▲ 900	▲ 1,000		
財政		▲ 1,800	▲ 9,400	▲ 2,000		
資金過不足		▲ 2,600	▲ 10,300	▲ 3,000		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		59,740				
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		13,000		5,100		
CP等買入				3,500		
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		300	100			
国債補完供給	即日	▲ 300	300			
		300				
小計		13,100	200	8,600		
当預増減		10,500	▲ 10,100	5,600		

≪ 2/18の日銀調節とレート予想 ≫					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,583,600	前日比	▲ 10,100
O/N	0~0.001	T/N	0~0.001	S/N	0~0.001
無担O/Nは、0~0.001%の出合いが中心になると見込まれる。					

≪ 17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1兆7,000億円増の192兆6,000億円(当座預金残高見込みは259兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、昨日と同様に0.001%でのオファーが並ぶなか、ビッドサイドはマイナス金利での調達希望で始まった。その後、国内勢より0~0.001%での調達が散見された。また、一部でマイナス金利での出合いも見られた。ターム物は、ショートタームで0.001%の出合いが見られた。

≪ 17日のオープン市場動向 ≫

現先レートS/Nは弱含みでの推移となった。短国市場は1Y物の入札が実施された。W I取引で▲0.20~▲0.195%の出合いが見られる中、按分落札利回りは▲0.1501% (按分比率46.4632%)、平均落札利回りは▲0.1601%と堅調な結果となった。セカンドリーでは1Y物で▲0.195%、3M物で▲0.118%の出合いが見られた。CP市場は五・十日発行となり、鉄鋼・ノンバンク業界から大型の発行案件が見られ、償還総額1,200億円程度に対し、発行総額は2,900億円程度まで膨らんだ。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。

≪ 18日の材料 ≫

- *石田日銀審議委員、福岡県金融経済懇談会にて講演
- *1月の貿易統計
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、2/22発行)
- *5年利付国債入札(25,000億円、2/22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	2,593,700	2/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,369,400		590,900
積み終了先	1,782,300	2/18以降の残り所要積立額	
超過準備	1,560,700	積数	230,400
非準備先残高	224,300	1日平均	8,500
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)			1,900,000
準備預金進捗率	87.87% (実績)		6.90% (日数)

JGB新発10年債	0.045	0.005	日経平均株価(終値)	15,836.36	▲ 218.07	為替(9時)	114.12-14
						為替(5時)	113.46-48

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	2/9	2/10	2/12	2/15	2/16	2/17
日銀当預残	2,547,000	2,519,700	2,511,000	2,564,600	2,583,200	2,593,700
準備預金残	2,302,100	2,285,000	2,273,000	2,332,700	2,353,400	2,369,400
レート	0.073%	0.072%	0.071%	0.074%	0.001%	-0.002%
月中平均	0.06644%	0.06745%	0.06821%	0.06860%	0.06438%	0.06047%

2/16のマナターベース		3,571,300	
2/16コール合計	45,360	無担	27,784
有担		有担	17,576
コール前日増減	計	▲ 119,909	無担 ▲ 51,700
			有担 ▲ 68,209

2/17の加重平均レート(速報)				2/16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		
▲0.05 ~0.001 (▲0.002)	0.001 (0.001)	(0.001)		O/N 0.000 ~0.001 (0.001)		0.001 (0.001)			
0.001 (0.001)				T/N	0.000 ~0.030 (0.026)				
				S/N					
0.000 ~0.010 (0.001)				1W	0.001 ~0.010 (0.003)				
0.001 (0.001)				2W	0.000 ~0.120 (0.050)				
				3W					
		0.001-0.10	-	1M					有担先日付分
		0.001-0.10	-	2M					
		0.001-0.10	▲0.118	3M					
		-	-	6M					
		-	▲0.200-▲0.195	1Y					

≪ オペ情報、入札結果 ≫

国債補完	8,045億円	2/17	~ 2/18 (1日間)	応札	237億円	落札	237億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)	
国債買入	700億円	2/19		応札	5,025億円	落札	701億円	按分利回り較差	0.060%	39.2%	平均利回り較差	0.072%
国債買入	2,600億円	2/19		応札	6,644億円	落札	2,611億円	按分利回り較差	0.000%	8.9%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	1,800億円	2/19		応札	4,290億円	落札	1,803億円	按分利回り較差	-0.024%	16.4%	平均利回り較差	-0.014%

米ドル資金供給(固定金利方式) 2/19~2/25 (6日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.880%

T-Bill1Y 応札10兆875億円 落札2兆3,251億7,000万円(非競争入札:1,748億円) 2/22~2017/2/20 ▲0.1501% 按分46.4632% 平均▲0.1601%

「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