

《資金需給》

単位 億円

	18日需給速報		19日需給予想		22日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	▲ 1,100			0
財政		▲ 10,200	2,900	▲ 36,000		
資金過不足		▲ 11,100	1,800	▲ 36,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					2,300	
59,740					▲ 2,800	
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			5,700			
CP等買入			3,500			
		▲ 200	▲ 600			
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		100	800			
国債補完供給	即日	▲ 100	400			
小計		▲ 200	9,800		▲ 500	
当預増減		▲ 11,300	11,600		▲ 36,500	

当座預金残高	2,582,400	2/18以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,355,700		230,400
積み終了先	1,850,400	2/19以降の残り所要積立額	
超過準備	1,817,300	積数	136,200
非準備先残高	226,700	1日平均	5,200
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	92.83% (実績)	10.34% (日数)	

2/17のマナターベース		3,582,500	
2/17コール 合計	46,707	無担	27,690
有担		有担	19,017
コール前日増減	計	1,347	無担
有担		▲ 94	有担
			1,441

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	
▲0.04 ~0.001 (▲0.009)	0.001	(0.001)		▲0.05 ~0.001 (▲0.002)		0.001	(0.001)		
0.000 ~0.001 (0.000)						0.001	(0.001)		
▲0.001~0.310 (0.008)				1W	0.000	(0.000)	0.000 ~0.010 (0.002)		
0.120	(0.120)			2W	0.001	(0.001)			
				3W					
0.250	(0.250)			1M					有担先日付分
				2M					
				3M			0.005	(0.005)	
				6M					
				1Y					

《オペ情報、入札結果》

全店共通	8,000億円	2/22 ~ 5/23 (91日間)	応札	2,270億円	落札	2,270億円	0.000%	全取	平均	0.000% (固定)
国債補完	7,993億円	2/18 ~ 2/19 (1日間)	応札	282億円	落札	282億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
国債補完	10,000億円	2/18 ~ 2/19 (1日間)	応札	120億円	落札	120億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
T-Bill3M	応札16兆6,130億円	落札4兆883億8,000万円(非競争入札:3,816億円)		2/22~5/23	▲0.1022%	按分62.4600%	平均▲0.1090%			
5年利付国債(表面利率0.1%)	応札8兆1,173億円	落札2兆2,765億円(非競争入札:2,233億円)		2/22~2020/12/20	▲0.120%	按分70.6338%	平均▲0.138%			

《 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	2,594,000	前日比	11,600
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。					

《 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、前日比1兆7,000億円減の190兆9,000億円(当座預金残高見込みは258兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、0%オファーに対し、▲0.001%での調達希望で始まった。その後、国内勢により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、ロール案件が数件見られた。共通担保資金供給オペは、3M物で8,000億円オファーされた。本日オファー分から金利が0%となり、2,270億円の落札(期落ち2,771億円)となった。

《 18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3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.11~▲0.108%の出合いが見られる中、按分落札利回りは▲0.1022%(按分比率62.46%)、平均落札利回りは▲0.1090%と概ね事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは1Y物で▲0.38~▲0.21%、6M物で▲0.165%、3M物で▲0.11~▲0.108%の出合いが見られた。3M物では特段の動きは無かったものの、1Y物では引き際に大きく買い進まれた。CP市場は5・10日の前倒し発行が見られ、機械・ノンバンク業態から大型の発行案件が実施されたため、償還総額1,450億円程度に対し、発行総額は1,550億円程度となった。発行レートは概ね低位横ばい圏で推移した。

《 19日の材料 》

- *米国1月の消費者物価指数
- *交付税特別会計借入(10,500億円、2/29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	0.07113%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07115%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	0.015	▲0.030	日経平均株価(終値)	16,196.80	360.44	為替(9時)	114.28-30
						為替(5時)	113.93-95

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	2/15	2/16	2/17	2/18
日銀当預残	2,519,700	2,511,000	2,564,600	2,583,200	2,593,700	2,582,400
準備預金残	2,285,000	2,273,000	2,332,700	2,353,400	2,369,400	2,355,700
レート	0.072%	0.071%	0.074%	0.001%	-0.002%	-0.009%
月中平均	0.06745%	0.06821%	0.06860%	0.06438%	0.06047%	0.05661%

「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