

◀資金需給▶

単位 億円

	22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		▲ 100	▲ 1,200	▲ 1,000
財政		▲ 41,200	5,000	4,000
資金過不足		▲ 41,300	3,800	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,300		
59,239		▲ 2,800		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			17,600	
国庫短期証売却				
国債買入			13,100	
CP等買入				
		▲ 300	▲ 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				
国債補完供給	即日	▲ 600	600	
		500		
小計		▲ 900	31,200	0
当預増減		▲ 42,200	35,000	3,000

◀ 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	2,585,900	前日比	35,000
O/N	▲0.02~0.001	T/N	▲0.02~0.001	S/N	▲0.02~0.001

無担O/Nは、0%前後での出会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、前営業日比3兆2,000億円減の188兆1,000億円(当座預金残高見込みは255兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.01%オフアーに対し、▲0.02%ビッドで始まった。その後、国内勢により▲0.01~0.001%での調達が見られ午前の取引を終えた。午後は、国内勢より▲0.01~0%での調達が散見されるなか本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件が数件見られた。

◀ 19日のオープン市場動向 ▶

現先レートS/Nは引続き、弱含みの展開となった。短国市場は様子見閑散で、1Y物で少額の出合いが見られた程度にとどまった。CP市場は建設、電気機器業態等からまとまった額の発行案件がみられ、償還総額500億円程度に対し、発行総額は1,800億円程度に膨らんだ。発行レートは一部銘柄で強含む動きがみられたものの、全体としては低位横ばい圏で推移した。

◀ 22日の材料 ▶

- \*米国1月の中古住宅販売
- \*米国12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- \*40年利付国債入札(4,000億円、2/25発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、3/2借入)

当座預金残高	2,550,900	2/22以降の残り所要積立額	57,800
準備預金残高	2,320,300	2/23以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,867,200	積数	48,800
超過準備	1,865,400	1日平均	2,200
非準預先残高	230,600	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	97.43% (実績)		24.14% (日数)

JGB新発10年債	-0.005	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	16,111.05	143.88	為替(9時)	112.51-54
						為替(5時)	112.87-89

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	2/15	2/16	2/17	2/18	2/19	2/22
日銀当預残	2,564,600	2,583,200	2,593,700	2,582,400	2,593,100	2,550,900
準備預金残	2,332,700	2,353,400	2,369,400	2,355,700	2,355,200	2,320,300
レート	0.074%	0.001%	-0.002%	-0.009%	-0.008%	-0.001%
月中平均	0.06860%	0.06438%	0.06047%	0.05661%	0.04738%	0.04518%

2/19のマナリーベース				3,584,000
2/19コール	合計	47,919	無担	31,005
			有担	16,914
コール前日増減	計	▲ 110	無担	2,347
			有担	▲ 2,457

2/22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	無担先日付分	有担当日分		
▲0.01~0.010(▲0.001)	0.001	(0.001)		▲0.04~0.001(▲0.008)		0.001	(0.001)	
▲0.01~0.000(▲0.005)				T/N	▲0.005~0.000(▲0.003)			
				S/N				
▲0.02~0.000(▲0.016)				1W	0.000	(0.000)	▲0.01~0.300(0.006)	
				2W			0.010(0.010)	
				3W				
		0.001-0.10	-	1M	▲0.02	(▲0.020)	有担先日付分	
		0.001-0.10	-	2M				
		0.001-0.10	-	3M				
		-	-	6M				
		-	▲0.36	1Y				

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完 26,209億円 2/22 ~ 2/23 (1日間) 応札 506億円 落札 506億円 -0.500% 全取 平均 -0.500%(即)  
 社債買入 750億円 2/26 応札 1,516億円 落札 750億円 按分レート -0.130% 50.0% 平均落札レート -0.031%  
 被災地支援(第58回) 2/26~2017/2/24 (364日間) 貸付予定総額 0億円 貸付利率 0%

「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