

《資金需給》

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想		26日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300	▲ 1,200	▲ 2,000		
財政		4,000	3,100	▲ 4,000		
資金過不足		2,700	1,900	▲ 6,000		
貸出			▲ 100			
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
65,630						
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		12,200	5,500			
CP等買入						
		▲ 200	▲ 400			
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			▲ 300			
ETF買入			100			
国債補充供給						
小計		37,000	4,800	0		
当預増減		39,700	6,700	▲ 6,000		

当座預金残高	1,830,800	2/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,666,600		52,500
積み終了先	1,360,000	2/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,360,000	積数	42,300
非準備先残高	164,200	1日平均	2,200
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	97.62% (実績)		32.14% (日数)

2/23のマナターベース		2,724,100	
2/23コール合計	203,494	無担	75,610
コール前日増減	計	▲ 2,569	無担
		▲ 838	有担
			▲ 1,731

2/24の加重平均レート(速報)			2/23の加重平均レート(確報)		
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
0.050 ~0.130 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.125 (0.078)	
0.050 ~0.120 (0.081)				T/N	0.073 ~0.125 (0.083)
				S/N	0.125 (0.125)
0.117 (0.117)				1W	
0.310 (0.310)				2W	0.114 (0.114)
				3W	
0.145 (0.145)		0.08-0.12	-	1M	0.145 ~0.150 (0.147)
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.01-▲0.007	3M	
		-		6M	
		-	▲0.01	1Y	

《オペ情報、入札結果》

CP買入 4,000億円 2/27 応札 11,307億円 落札 3,981億円 按分レート 0.091% 11.7% 平均落札レート 0.094%

米ドル資金供給(固定金利方式) 2/26~3/5 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.620%

40年利付国債(表面利率1.7%) 応札1兆3,572億円 落札3,995億円 2/26~2054/3/20 1.550% 按分79.4805%

交付税特会 1兆500億円 3/4~9/2 応札 3兆3,342億円 落札 1兆500億100万円 0.087% 按分 62.9818% 平均 0.086%

「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。」

2/25の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,837,500	前日比	6,700
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

試し取りにより、加重平均は高めとなる事が予想されるが、出合いの中心は0.07%前半になると見込まれる。

《 24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、137兆1,000億円(当座預金残高見込みは183兆1,000億円)。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った。出合いの中心は0.073~0.074%と昨日と同様、やや強めの立ち上がりとなった。一巡後は、調達レートが低下し、0.07%での出合いが数件見られる程度で本日の取引を終えた。本日も一部業態が試し取りを行ったため、加重平均が若干上昇した。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが中心となった。

《 24日のオープン市場動向 》

現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、総じて閑散とした地合いであったものの、3Mが▲0.01%まで買い進まれる場面が見られた。CP市場は、1,500億円程度の償還に対し、月末を目前に控えて3,000億程度まで発行が膨らんだ。発行レートは高止まりの水準が継続していた。CP等買入オペが実施され、平均落札利回り0.094%、按分落札利回り0.091%、按分率11.7%と前回とほぼ同水準となるなど、高めでの決着となった。

《 25日の材料 》

\*イエレンFRB議長、下院金融委員会で議会証言  
\*米国1月の新築一戸建て販売件数

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	118.90-92
0.375 ▲ 0.005	18,603.48 136.56	為替(5時)	119.24-26

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	2/17	2/18	2/19	2/20	2/23	2/24
日銀当預残	1,830,900	1,843,100	1,829,300	1,810,400	1,791,100	1,830,800
準備預金残	1,664,500	1,682,500	1,659,000	1,646,000	1,628,900	1,666,600
レート	0.079%	0.077%	0.082%	0.075%	0.078%	0.077%
月中平均	0.07418%	0.07433%	0.07474%	0.07477%	0.07491%	0.07500%

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