

◀資金需給▶

単位 億円

	28日需給速報		3日需給予想		4日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,100		600		0
財政		10,900		▲ 22,600		▲ 35,000
資金過不足		9,800		▲ 22,000		▲ 35,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)				3,300		
159,338				▲ 2,200		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						20,000
国庫短期証売却						
国債買入		6,000				6,400
CP等買入						
		▲ 5,400		▲ 300		
貸出支援基金						
(成長) 34,599						
(増加) 50,859						
被災地支援						
3,805						
社債等買入						
ETF買入		100		100		
国債補完供給						
小計		700		900		26,400
当預増減		10,500		▲ 21,100		▲ 8,600

当座預金残高	1,140,300	2/28以降の残り所要積立額	62,700
準備預金残高	1,033,000	3/3以降の残り所要積立額	41,000
積み終了先	896,100	積数	3,200
超過準備	896,100	1日平均	3,200
非準備先残高	107,300		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,684,600		
準備預金進捗率	97.57% (実績)	53.57% (日数)	

2/27のマネタリーベース		2,035,900	
2/27コール	合計	162,077	無担 56,005 有担 106,072
コール前日増減	計	▲ 5,097	無担 ▲ 6,217 有担 1,120

2/28 の加重平均レート(速報)				2/27 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	有担当日分	有担先日付分
0.060 ~0.125 (0.072)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.055 ~0.150 (0.073)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.070 ~0.125 (0.081)				T/N	0.070 ~0.122 (0.089)		
				S/N			
0.117 (0.117)				1W	0.114 ~0.150 (0.119)		
0.118 ~0.300 (0.133)				2W	0.195 (0.195)	0.121 ~0.180 (0.129)	
0.118 (0.118)				3W			
0.118 (0.118)		0.08-0.13	-	1M		0.118 (0.118)	有担先日付分
0.120 (0.120)		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.035-0.036	3M		0.120 (0.120)	
		-	-	6M			
		-	0.041-0.042	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国短買入	20,000億円	3/4	応札	52,111億円	落札	20,003億円	按分利回り較差	-0.004%	42.6%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	2,500億円	3/4	応札	10,913億円	落札	2,503億円	按分利回り較差	0.001%	28.2%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	2,500億円	3/4	応札	12,113億円	落札	2,506億円	按分利回り較差	0.000%	33.3%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	1,400億円	3/4	応札	5,219億円	落札	1,401億円	按分価格較差	-0.060円	80.3%	平均価格較差	-0.082円

成長基盤強化(第15回) 3/7~2015/3/6 (364日間) 貸付予定総額 1,866億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 64 先  
 成長基盤強化(第11回の借り換え) 3/7~2015/3/6 (364日間) 貸付予定総額 950億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 66 先  
 成長基盤強化(第7回の借り換え) 3/7~2015/3/6 (364日間) 貸付予定総額 907億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 56 先  
 成長基盤強化(第3回の借り換え) 3/7~2015/3/6 (364日間) 貸付予定総額 2,398億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 82 先  
 ETF買入 123億円 約定日 2/28  
 J-REIT買入 3億円 約定日 2/28

◀ 3/3の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,119,200	前日比	▲ 21,100
O/N	0.06~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07%前後の出合いが中心となろう。

◀ 28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は、前日比2兆3,000億円増加の89兆8,000億円(当座預金残高見込は114兆1,000億円)。月末を挟む取引となる無担O/Nは、大手行から0.06~0.065%、地銀および信託業態から0.065~0.07%付近のビッドで、0.07%中心の取引から始まった。出し取り一巡後は0.065%程度の散発的な取引で推移。午後は一部調整の動きが見られた程度で、一日の取引を終了した。ターム物では2W~1M物を、大手行が0.118%で調達した。

◀ 28日のオープン市場動向 ▶  
 現先レートS/Nは0.06%近辺と、前日から低下。短国アウトライト市場は3M:0.035~0.036%、1Y:0.041~0.042%の出合い。短国買入オペが2兆円通知され、平均利回較差▲0.002%、按分利回較差▲0.004%、按分比率42.6%という結果になった。オペ結果後もタイトな需給環境が続いている。CP市場は、発行総額700億円程度と少ない。前日に続いて、動意に乏しい状況となっている。

◀ 3日の材料 ▶  
 \*10-12月期の法人企業統計調査季報  
 \*2月実績/3月見込み財政資金対民間取支  
 \*米国1月の個人所得・消費支出 \*米国1月の建設支出  
 \*米国2月のISM製造業景況指数

◀コール2月の加重平均レート▶			
(土日を含む)	無担	0.07554%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07658%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	0.585	0.000	日経平均株価(終値)	14,841.07	▲ 82.04	為替(9時)	102.12-13
						為替(5時)	101.65-67

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	2/21	2/24	2/25	2/26	2/27	2/28
日銀当預残	1,120,600	1,098,600	1,127,000	1,135,200	1,129,800	1,140,300
準備預金残	1,014,900	997,500	1,016,300	1,018,300	1,014,400	1,033,000
レート	0.079%	0.073%	0.080%	0.079%	0.073%	0.072%
月中平均	0.07557%	0.07546%	0.07564%	0.07577%	0.07567%	0.07554%

「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