

**<<資金需給>>**

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想		5日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		700	700	1,000		
財政		▲ 22,900	▲ 36,000	▲ 4,000		
資金過不足		▲ 22,200	▲ 35,300	▲ 3,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		3,300				
160,417		▲ 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			6,400	2,900		
CP等買入						
		▲ 300	▲ 200			
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				
国債補完供給						
小計		900	26,200	2,900		
当預増減		▲ 21,300	▲ 9,100	▲ 100		

当座預金残高	1,119,000	3/3以降の残り所要積立額	41,000
準備預金残高	1,004,900	3/4以降の残り所要積立額	36,000
積み終了先	869,500	積数	3,000
超過準備	869,500	1日平均	3,000
非準備先残高	114,100	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	97.86% (実績)		57.14% (日数)

2/28のマネタリーベース		2,047,500	
2/28コール	合計	156,111	無担 50,346 有担 105,765
コール前日増減	計	▲ 5,966	無担 ▲ 5,659 有担 ▲ 307

3/3の加重平均レート(速報)				2/28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 ~0.145 (0.074)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.125 (0.072)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.065 ~0.125 (0.094)				T/N	0.070 ~0.125 (0.081)		
				S/N			
0.100 ~0.400 (0.134)				1W	0.117 (0.117)		
0.095 ~0.118 (0.107)				2W	0.118 ~0.300 (0.126)		
0.118 (0.118)				3W	0.118 (0.118)		
		0.08-0.13	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.13	-	2M	0.120 (0.120)		
		0.08-0.13	0.0340	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	2,000億円	3/3	~ 3/4 (1日間) 応札	40億円	落札	40億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	1,100億円	3/5	応札	4,369億円	落札	1,101億円	按分利回り較差	-0.003%	86.8%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	1,800億円	3/5	応札	7,366億円	落札	1,811億円	按分利回り較差	-0.014%	78.1%	平均利回り較差	-0.013%
ETF買入	123億円	約定日 3/3									
J-REIT買入	3億円	約定日 3/3									

<< 3/4の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,109,900	前日比	▲ 9,100
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。

<< 3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1兆6,000億円減少の88兆2,000億円(当座預金残高見込は111兆9,000億円)。無担O/Nは0.071%の出合いで立ち上がり。大手行から0.06%、地銀および信託業態から0.07%前後の調達希望が始まった。調達意欲は強くないものの、一巡後以降も0.07%近辺での出合いが散見された。また、一部業態から試し取りと思われる調達も行われ本日の取引を終了した。タム物は、引き続きロール案件による出合いが散見された。

<< 3日のオープン市場動向 >>  
 現先レートは低下。短国市場は売り物が無く全般的に様子見閑散。CP市場は5日発行となり鉄鋼、建設、ノンバンク業態でまとまった発行が見られ、発行総額は2,000億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいでの推移。

- << 4日の材料 >>  
 \*1月の毎月勤労統計調査速報  
 \*2月のマネタリーベース  
 \*3月の日銀当座預金増減要因見込み  
 \*10年利付国債入札(24,000億円、3/20発行)  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、3/12借入)

<<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	0.575	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	14,652.23	▲ 188.84	為替(9時)	101.33-34
						為替(5時)	101.35-36

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	2/24	2/25	2/26	2/27	2/28	3/3
日銀当預残	1,098,600	1,127,000	1,135,200	1,129,800	1,140,300	1,119,000
準備預金残	997,500	1,016,300	1,018,300	1,014,400	1,033,000	1,004,900
レート	0.073%	0.080%	0.079%	0.073%	0.072%	0.074%
月中平均	0.07546%	0.07564%	0.07577%	0.07567%	0.07554%	0.07267%

「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