

資金需給

単位 億円

	27日需給速報		2日需給予想		3日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,000		800		1,000
財政		7,700		▲ 23,900		▲ 11,000
資金過不足		5,700		▲ 23,100		▲ 10,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)				2,200		
65,630				▲ 2,100		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						15,000
国庫短期証売却						
国債買入		12,300				12,000
CP等買入		▲ 4,000				
		▲ 3,800		▲ 700		
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		▲ 200		
ETF買入						
国債補充供給						
小計		12,200		▲ 800		27,000
当預増減		17,900		▲ 23,900		17,000

当座預金残高	1,848,600	2/27以降の残り所要積立額	28,000
準備預金残高	1,687,200	3/2以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,386,400	積数	15,800
超過準備	1,385,100	1日平均	1,100
非準備先残高	161,400	積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,774,900
準備預金進捗率	99.11% (実績)		50.00% (日数)

2/26のマナターベース		2,768,700	
2/26コール	合計	203,195	無担 76,237 有担 126,958
コール前日増減	計	▲ 8,789	無担 ▲ 7,749 有担 ▲ 1,040

2/27の加重平均レート(速報)				2/26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
0.040 ~ 0.130 (0.074)	0.030 ~ 0.040 (0.031)					0.030 ~ 0.130 (0.075)		0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.073 ~ 0.120 (0.082)							0.074 ~ 0.120 (0.101)	
							0.075 ~ 0.100 (0.084)	
0.070 ~ 0.260 (0.127)							0.120 (0.120)	
0.110 ~ 0.230 (0.124)							0.083 ~ 0.118 (0.116)	
				0.08-0.13	-			0.100 (0.100)
				0.08-0.12	0.0000			
				0.08-0.12	▲ 0.001-0.0025			
				-	-			
				-	▲ 0.01			

オペ情報、入札結果

国短買入	15,000億円	3/3	応札	25,720億円	落札	15,003億円	按分利回り較差	-0.002%	54.9%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	3/3	応札	9,246億円	落札	4,000億円	按分利回り較差	-0.014%	60.0%	平均利回り較差	-0.007%
国債買入	4,000億円	3/3	応札	11,320億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	-0.002%	96.4%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	3/3	応札	10,439億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.005%	78.1%	平均利回り較差	0.007%

- 成長基盤強化(本則第19回) 3/6~2019/3/4 (1,459日間) 貸付予定額6,463億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 71先
- 成長基盤強化(本則第15回の借り換え) 3/6~2016/3/4 (364日間) 貸付予定額 936億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 53先
- 成長基盤強化(本則第11回の借り換え) 3/6~2016/3/4 (364日間) 貸付予定額 528億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 54先
- 成長基盤強化(本則第 7回の借り換え) 3/6~2016/3/4 (364日間) 貸付予定額 516億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 46先
- 成長基盤強化(ABL等特則第15期) 3/6~2019/3/6 (1,461日間) 貸付予定額 54億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 2先
- 成長基盤強化(ABL等特則第7期の借り換え) 3/6~2017/3/6 (731日間) 貸付予定額 39億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 3先
- 成長基盤強化(小口特則第12期) 3/6~2019/3/4 (1,459日間) 貸付予定額 15.52億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 20先
- 成長基盤強化(小口特則第8期の借り換え) 3/6~2016/3/4 (364日間) 貸付予定額 3.31億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 8先
- 成長基盤強化(小口特則第4期の借り換え) 3/6~2016/3/4 (364日間) 貸付予定額 1.61億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 7先
- 成長基盤強化(米ドル特則第11期) 3/6~2016/3/4 (364日間) 貸付予定額 9百万ドル 貸付先数 8先
- 成長基盤強化(米ドル特則第7期の借り換え) 3/6~2016/3/4 (364日間) 貸付予定額 1,418百万ドル 貸付先数 25先
- 成長基盤強化(米ドル特則第3期の借り換え) 3/6~2016/3/4 (364日間) 貸付予定額 1,183百万ドル 貸付先数 13先

「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。」

3/2の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,824,700	前日比	▲ 23,900
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.07%台前半での出会いが中心になると見込まれる。

27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、138兆6,000億円(当座預金残高見込みは184兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.074%、大手行からは0.07%での調達希望で始まり、出会いの中心は0.074%と昨日よりもやや弱めの立ち上がりとなった。一巡後は、ビッドが薄くなり、0.07%近辺での出会いが散見される程度で今月の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出会いは見られなかった。

27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、短国買入オペが15,000億円と通知された。足切レート▲0.002%と、前回比で10,000億円減額されたものの、底堅い結果となった。オペ後は3M物が▲0.001~0.0025%、1Y物が▲0.01%での出会いが見られた。C/P発行市場は、通信・鉄鋼業態等から大型発行案件が実施された。C/P発行レートは発行残高が積みあがる中、荷もたれ感が強く、依然として高止まりの決着が続いていた。

2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収支
- *米国1月の個人所得・消費支出 *米国2月のISM製造業景況指数
- *米国1月の建設支出 *ユーロ圏2月の消費者物価指数速報値

コール2月の加重平均レート			
(土日を含む)	無担	0.07532%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07621%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.330	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	18,797.94	12.15	為替(9時)	119.38-40
						為替(5時)	119.28-30

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	2/20	2/23	2/24	2/25	2/26	2/27
日銀当座預金	1,810,400	1,791,100	1,830,800	1,837,400	1,830,700	1,848,600
準備預金残	1,646,000	1,628,900	1,669,200	1,668,000	1,663,000	1,687,200
レート	0.075%	0.078%	0.077%	0.086%	0.075%	0.074%
月中平均	0.07477%	0.07491%	0.07500%	0.07544%	0.07542%	0.07532%

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