

<<資金需給>>

単位 億円

	2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
銀行券		700	300	1,000
財政		▲ 23,300	▲ 12,200	▲ 32,000
資金過不足		▲ 22,600	▲ 11,900	▲ 31,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,200		
65,790		▲ 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			12,100	4,300
CP等買入				
		▲ 700	▲ 300	
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		▲ 200		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 800	26,800	4,300
当預増減		▲ 23,400	14,900	▲ 26,700

当座預金残高	1,825,200	3/2以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,658,200		15,800
積み終了先	1,364,900	3/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,364,600	積数	13,600
非準備先残高	167,000	1日平均	1,000
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	99.23% (実績)	53.57% (日数)	

2/27のマネタリーベース		2,788,700	
2/27コール	合計	201,319	無担 73,608 有担 127,711
コール前日増減	計	▲ 1,876	無担 ▲ 2,629 有担 753

3/2の加重平均レート(速報)				2/27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		有担当日分
0.060	~0.130 (0.075)	0.030	~0.040 (0.031)			0.040	~0.130 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.074	~0.120 (0.081)							
							0.073 ~0.120 (0.082)	
0.095	~0.118 (0.106)						0.070 ~0.260 (0.127)	
0.118	(0.118)					0.118	(0.118)	0.110 ~0.230 (0.127)
0.120	(0.120)							
				0.08-0.13	-			
				0.08-0.12	-			
				0.08-0.12	▲0.002-0.00			
				-	-			
				-	-			
				-	-			

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	500億円	3/4	応札	2,070億円	落札	500億円	按分利回り較差	0.043%	99.8%	平均利回り較差	0.043%
国債買入	2,400億円	3/4	応札	6,827億円	落札	2,407億円	按分利回り較差	-0.004%	73.1%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	1,400億円	3/4	応札	4,287億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	-0.009%	9.9%	平均利回り較差	-0.005%

「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

<< 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	1,840,100	前日比	14,900
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%台前半の出合いが中心になると見込まれる。

<< 2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1兆4,000億円減の13兆2,000億円(当座預金残高見込みは18兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.073~0.075%での調達で始まった。財政等要因により大幅な不足地合いとなった事で、出合い一巡後もビッドは0.07%台前半で底堅く推移し本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から2W物0.118%でまとまった調達が見られた。

<< 2日のオープン市場動向 >>
現先S/N物は小幅低下した。短国市場は、閑散な中3M▲0.002~0%で出合いが見られた程度であった。CP市場は償還総額1,300億円程度に対し、電機・石油業態からのまとまった発行案件が見られたものの、発行案件は700億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での動きであった。

<< 3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、3/10借入)

<<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		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.345	0.015	18,826.88	28.94	119.82-84	119.84-85

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	2/23	2/24	2/25	2/26	2/27	3/2
日銀当預残	1,791,100	1,830,800	1,837,400	1,830,700	1,848,600	1,825,200
準備預金残	1,628,900	1,669,200	1,668,000	1,663,000	1,687,200	1,658,200
レート	0.078%	0.077%	0.086%	0.075%	0.074%	0.075%
月中平均	0.07491%	0.07500%	0.07544%	0.07542%	0.07532%	0.07450%

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