

<<資金需給>>

単位 億円

	5日需給速報		6日需給予想		9日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		0	▲ 300		1,000	
財政		5,700	5,300	▲ 6,000		
資金過不足		5,700	5,000	▲ 5,000		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		65,790			1,000	▲ 1,400
国債買現		0				
CP買現		0				
国庫短期証買入						
国庫短期証売却						
国債買入			11,700			
CP等買入						
貸出支援基金		▲ 500	▲ 300			
(成長) 44,583			8,600			
(増加) 189,789			▲ 6,200			
被災地支援						
3,252						
社債等買入		▲ 100				
ETF買入						
国債補完供給	即日	▲ 200	200			
小計		▲ 800	14,000	▲ 400		
当増減		4,900	19,000	▲ 5,400		

当座預金残高	1,806,900	3/5以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,639,800		11,200
積み終了先	1,351,300	3/6以降の残り所要積立額	
超過準備	1,351,300	積数	10,000
非準備先残高	167,100	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	99.44%	(実績)	64.29% (日数)

3/4のマネタリーベース		2,740,600	
3/4コール合計	210,437	無担	83,922
有担	126,515		
コール前日増減	計	1,903	無担
有担	1,625	有担	278

<< 3/6の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,825,900	前日比	19,000
O/N	0.06~0.08	T/N	0.06~0.125	S/N	0.06~0.125

無担O/Nは0.075%前後の出合いが中心になると見込まれる。

<< 5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、前日比8,000億円増の135兆7,000億円(当座預金残高見込みは180兆7,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.074~0.075%での調達で始まった。一巡後は、ビッド水準がやや低下し、0.07%台前半の出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。また、本日は複数の邦銀から0.125%での試し取りが行われた。ターム物は、大手行から1W物0.117%での調達が見られた。

<< 5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、3M物入札(516回)が実施された。入札結果は平均落札利回り▲0.0004%、按分落札利回り0.0020%と、事前の予想よりもやや落ち着いた結果でとなった。セカンダリーは3Mで▲0.005~0.004%で出合いが見られた。CP発行市場は、1,000億円程度の償還に対し、1,200億円程度の発行となり、発行総額、発行件数ともにやや限定的であった。発行レートは概ね横ばい圏であった。

<< 6日の材料 >>
 *1月の景気動向指数速報 *2月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *米国1月の貿易収支 *米国1月の消費者信用残高 *米国2月の雇用統計
 *ユーロ圏10-12月期のGDP改定値
 *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、3/10発行)

<<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	0.400	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	18,751.84	48.24	為替(9時)	119.63-65
						為替(5時)	119.79-82

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	2/26	2/27	3/2	3/3	3/4	3/5
日銀当座預残	1,830,700	1,848,600	1,825,200	1,839,800	1,802,000	1,806,900
準備預金残	1,663,000	1,687,200	1,660,500	1,674,800	1,639,300	1,639,800
レート	0.075%	0.074%	0.075%	0.075%	0.075%	0.080%
月中平均	0.07542%	0.07532%	0.07450%	0.07467%	0.07475%	0.07580%

3/5の加重平均レート(速報)				3/4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		有担当日分		
0.055 ~0.130 (0.080)	0.030	~0.040 (0.031)				0.060	~0.130 (0.075)		0.075	~0.120 (0.079)	0.030	~0.040 (0.031)
0.074 ~0.120 (0.077)									0.100	(0.100)		
0.075 ~0.117 (0.111)									0.077	~0.117 (0.114)		
0.121 (0.121)									0.078	~0.340 (0.109)		
									0.088	(0.088)		
0.080 ~0.150 (0.115)				0.08-0.13	-	1M						有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M						
				0.08-0.12	▲0.005-0.004	3M						
				-	-	6M						
				-	-	1Y						

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	3/9	~	6/8 (91日間)	応札	990億円	落札	990億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	6,000億円	3/5	~	3/6 (1日間)	応札	186億円	落札	186億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
T-Bill3M	応札22兆3,877億4,000万円	落札5兆2,479億3,000万円(非競争入札:4,420億円)	3/9~6/8	0.0020%	按分	51.9798%	平均	▲0.0004%				
30年利付国債(表面利率1.5%)	応札2兆4,155億円	落札6,416億円(I非競争入札:580億円)	3/20~2045/3/20	1.526%	按分	34.4827%	平均	1.510%				
交付税特会	1兆500億円	3/13~9/11	応札2兆8,831億円	落札1兆500億円	0.085%	按分	70.8358%	平均	0.084%			
J-REIT買入	12億円	約定日	3/5									

「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