

《資金需給》

単位 億円

	4日需給速報		7日需給予想		8日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 200	1,100	1,000		
財政		3,500	▲ 4,300	3,000		
資金過不足		3,300	▲ 3,200	4,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			200			
58,669			▲ 500			
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入				7,500		
国庫短期証売却						
国債買入		5,500		12,600		
CP等買入						
		▲ 600	▲ 700			
貸出支援基金		7,100	100			
(成長) 63,577						
(増加) 271,714		▲ 3,400	▲ 100			
被災地支援						
3,144						
社債等買入						
ETF買入		100				
国債補充供給		100				
小計		8,800	▲ 1,000	20,100		
当預増減		12,100	▲ 4,200	24,100		

3/7の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,557,500	前日比	▲ 4,200
O/N	▲0.02~0.001	T/N	▲0.02~0.001	S/N	▲0.02~0.001

無担O/Nは、0%前後での出合いが中心になると見込まれる。

《 4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3,000億円増の187兆3,000億円(当座預金残高見込みは、256兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、▲0.01%のオファーに対し、▲0.02%のビッドで始まった。その後、国内勢より▲0.01~0.001%での調達が見られ午前の取引を終えた。午後に入ってもレート水準は変わらず、▲0.01~0.001%での出合いが数件見られる程度で今週の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で0%前後での出合いが散見された。

《 4日のオープン市場動向 》
 現先レートS/Nは低水準で推移した。短国市場は短国買入オペが前回と同額の7,500億円でおfferされた。平均利回較差+0.022%、按分利回較差+0.018%となるなど、全般的にレートが低下している中、足元の在庫の重さからかオペでの売却ニーズを反映した小甘い結果となった。その他は特段目立った出合いは見られず、終日閑散だった。CP市場は償還総額700億円程度に対して、発行案件少なく発行総額は400億円程度となった。発行レートは引き続き低位横ばいで推移しており、期越え物を中心に0%の発行も見られた。

《 7日の材料 》
 *黒田日銀総裁、読売国際経済懇話会における講演
 *2月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *1月の景気動向指数速報
 *米国1月の消費者信用残高
 *米国2月のFRB労働市場情勢指数

《コール2月の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	0.03379%	有担 0.01652%
(営業日のみ)	無担	0.03250%	有担 0.01600%

当座預金残高	2,561,700	3/4以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,313,400		1,700
積み終了先	1,877,300	3/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,877,100	積数	400
非準備先残高	248,300	1日平均	0
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)			1,917,300
準備預金進捗率	99.98%	(実績)	68.97% (日数)

JGB新発10年債	-0.040	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	17,014.78	54.62	為替(9時)	113.68-70
						為替(5時)	113.87-89

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	2/29	3/1	3/2	3/3	3/4
日銀当座預金	2,585,900	2,589,900	2,592,700	2,553,700	2,549,600	2,561,700
準備預金残	2,334,900	2,346,000	2,337,000	2,300,300	2,305,100	2,313,400
レート	-0.002%	-0.001%	-0.003%	-0.002%	-0.002%	-0.001%
月中平均	0.03504%	0.03379%	-0.00300%	-0.00250%	-0.00233%	-0.00167%

3/3のマネタリーベース				3,547,700	
3/3コール合計	59,430	無担	43,853	有担	15,577
コール前日増減	計	3,254	無担	4,099	有担 ▲ 845

3/4の加重平均レート(速報)				3/3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			
▲0.03 ~ 0.001 (▲0.001)	0.001	(0.001)		O/N ▲0.04 ~ 0.001 (▲0.002)		0.001	(0.001)		
0.000 ~ 0.001 (0.001)				T/N	0.000 ~ 0.001 (0.001)				
				S/N					
0.000 ~ 0.300 (0.008)				1W ▲0.01 ~ 0.000 (▲0.006)	0.000 ~ 0.001 (0.000)				
				2W	0.000 (0.000)				
				3W					
		0.001-0.10	-	1M	0.000 (0.000)		有担先日付分		
		0.001-0.10	-	2M					
		0.001-0.10	-	3M					
		-	-	6M					
		-	-	1Y					

《オペ情報、入札結果》

国債補完	5,990億円	3/4	~ 3/7 (3日間) 応札	4億円	落札	4億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
国債買入	7,500億円	3/8	応札	30,264億円	落札	7,502億円	0.018%	75.8%	平均利回り較差	0.022%
国債買入	4,000億円	3/8	応札	9,627億円	落札	4,003億円	0.001%	78.4%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,200億円	3/8	応札	14,480億円	落札	4,208億円	-0.015%	64.6%	平均利回り較差	-0.013%
国債買入	2,600億円	3/8	応札	7,617億円	落札	2,604億円	-0.023%	58.2%	平均利回り較差	-0.018%
国債買入	1,800億円	3/8	応札	4,834億円	落札	1,800億円	-0.070%	10.0%	平均利回り較差	-0.053%

J-REIT買入 12億円 約定日 3/4

「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