

《資金需給》

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想	6日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		600	400	0
財政		▲ 35,900	▲ 2,400	6,000
資金過不足		▲ 35,300	▲ 2,000	6,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
160,417				
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	3,100	
CP等買入				
		▲ 200	▲ 300	
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				
国債補完供給				
小計		26,200	2,800	0
当預増減		▲ 9,100	800	6,000

当座預金残高	1,109,900	3/4以降の残り所要積立額	36,000
準備預金残高	996,300	3/5以降の残り所要積立額	31,600
積み終了先	862,400	積数	2,900
超過準備	862,400	1日平均	2,900
非準備先残高	113,600		
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	98.12% (実績)	60.71% (日数)	

3/3のマナターベース		2,025,600	
3/3コール 合計	160,710	無担	56,592
有担	104,118		
コール前日増減	計	4,599	無担
有担	6,246	有担	▲ 1,647

3/4の加重平均レート(速報)				3/3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
0.055 ~0.145 (0.074)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.145 (0.074)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.070 ~0.130 (0.086)				T/N	0.065 ~0.125 (0.094)		
				S/N			
0.075 ~0.295 (0.125)				1W	0.100 ~0.400 (0.134)		
0.118 ~0.340 (0.122)				2W	0.095 ~0.200 (0.116)		
0.118 ~0.300 (0.123)				3W	0.118 (0.118)		
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	-	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

《オペ情報、入札結果》

米ドル資金供給(固定金利方式) 3/6~3/13 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.580%
 米ドル資金供給(固定金利方式) 3/6~5/30 (85日間) 応札なし 貸付利率 0.580%
 10年利付国債(表面利率0.6%) 応札7兆6,933億円 落札2兆1,880億円(I非競争入札:2,057億円) 3/20~2024/3/20 0.600% 按分8.4024% 平均0.597%
 交付税特会 1兆500億円 3/12~9/11 応札 3兆4,539億円 落札 1兆500億円 0.096% 按分 34.4000% 平均 0.095%
 J-REIT買入 3億円 約定日 3/4

《 3/5の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,110,700	前日比	800
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。

《 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は、前日比1兆6,000億円減少の86兆6,000億円(当座預金残高見込は111兆円)。無担O/Nの立ち上がりは大手行から0.06%、地銀・信託・証券業態から0.07%前後の調達希望で始まった。税揚げ日であったこともあり、昨日よりやや堅調であったものの取り急ぎ動きはなく、一巡後も昨日と同様に0.07%近辺で推移しつつ、取引を終了した。本日も、一部業態から試し取りと思われる調達が行われた。ターム物は、大手行から1W0.117%、2Wで0.118%の調達が行われた。米ドル資金供給オペが2本オファーされ、いずれも応札は無かった。

《 4日のオープン市場動向 》
 現先レートは低位横ばいで推移。短国市場は引き続き売り物少なく全般的に閑散。CP市場も入札件数、発行額共に少なく総額800億円程度の出合いと閑散であった。

《 5日の材料 》
 *米国バージョンブック
 *米国2月のISM非製造業景況指数
 *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
 *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	0.07554%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07658%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	0.580	0.005	日経平均株価(終値)	14,721.48	69.25	為替(9時)	101.42-43
						為替(5時)	101.80-81

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	2/25	2/26	2/27	2/28	3/3	3/4
日銀当預残	1,127,000	1,135,200	1,129,800	1,140,300	1,119,000	1,109,900
準備預金残	1,016,300	1,018,300	1,014,400	1,033,000	1,005,500	996,300
レート	0.080%	0.079%	0.073%	0.072%	0.074%	0.074%
月中平均	0.07564%	0.07577%	0.07567%	0.07554%	0.07267%	0.07300%

「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