

<<資金需給>>

単位 億円

| | 5日需給速報 | | 6日需給予想 | 7日当社予想 |
|------------|--------|---------|--------|---------|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | 600 | ▲ 100 | ▲ 1,000 |
| 財政 | | ▲ 2,500 | 2,000 | 5,000 |
| 資金過不足 | | ▲ 1,900 | 1,900 | 4,000 |
| 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 | | | | |
| 国庫短期証売却 | | | | |
| 国債買入 | | 3,100 | | 9,000 |
| CP等買入 | | ▲ 300 | ▲ 300 | |
| 貸出支援基金(成長) | | | | 6,300 |
| 34,599(増加) | | | | ▲ 7,400 |
| 被災地支援 | | | | |
| 3,805 | | | | |
| 社債等買入 | | | | |
| ETF買入 | | | | |
| 国債補完供給 | | | | |
| 小計 | | 2,800 | ▲ 300 | 7,900 |
| 当預増減 | | 900 | 1,600 | 11,900 |

| | | | |
|---------------------------|-------------|---------------|-------------|
| 当座預金残高 | 1,110,800 | 3/5以降の残り所要積立額 | |
| 準備預金残高 | 995,400 | | 31,600 |
| 積み終了先 | 862,300 | 3/6以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 862,300 | 積数 | 27,600 |
| 非準備先残高 | 115,400 | 1日平均 | 2,800 |
| 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 | 98.36% (実績) | | 64.29% (日数) |

| 3/4のマナターベース | | 2,015,800 | |
|-------------|----|-----------|----------------------|
| 3/4コール | 合計 | 166,219 | 無担 62,065 有担 104,154 |
| コール前日増減 | 計 | 5,509 | 無担 5,473 有担 36 |

| 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) | | 無担当日分 | | 無担先日付分 | | 有担当日分 |
| 0.060 ~0.145 (0.078) | 0.040 ~0.050 (0.041) | | | O/N | 0.055 ~0.145 (0.074) | | | 0.040 ~0.050 (0.041) |
| 0.070 ~0.130 (0.091) | | | | T/N | | 0.070 ~0.130 (0.086) | | |
| | | | | S/N | | | | |
| 0.117 ~0.130 (0.119) | | | | 1W | | 0.075 ~0.295 (0.125) | | |
| 0.118 ~0.180 (0.139) | | | | 2W | | 0.118 ~0.340 (0.122) | | |
| | | | | 3W | | 0.118 ~0.300 (0.123) | | |
| 0.125 (0.125) | | 0.08-0.13 | - | 1M | | | | 有担先日付分 |
| | | 0.08-0.13 | - | 2M | | | | |
| | | 0.08-0.13 | 0.0330 | 3M | 0.135 (0.135) | | | |
| | | - | 0.03-0.033 | 6M | | | | |
| | | - | - | 1Y | | | | |

<<オペ情報、入札結果>>

| | | | | | | | | | | | |
|----------|--------------|------|----------------------------------|----------|----|---------|------------|---------|-----------|-----------|--------|
| CP買入 | 5,000億円 | 3/10 | 応札 | 12,939億円 | 落札 | 4,394億円 | 按分レート | 0.088% | 44.2% | 平均落札レート | 0.092% |
| 国債買入 | 2,500億円 | 3/7 | 応札 | 12,117億円 | 落札 | 2,505億円 | 按分利回り較差 | 0.002% | 67.8% | 平均利回り較差 | 0.002% |
| 国債買入 | 2,500億円 | 3/7 | 応札 | 11,945億円 | 落札 | 2,504億円 | 按分利回り較差 | 0.005% | 17.5% | 平均利回り較差 | 0.006% |
| 国債買入 | 4,000億円 | 3/7 | 応札 | 13,751億円 | 落札 | 4,008億円 | 按分利回り較差 | 0.006% | 63.1% | 平均利回り較差 | 0.007% |
| T-Bill6M | 応札23兆2,016億円 | | 落札3兆2,154億5,000万円(非競争入札:2,845億円) | | | | 3/10/~9/10 | 0.0357% | 按分7.8707% | 平均0.0337% | |
| J-REIT買入 | 3億円 | 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す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

| << 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 | 1,112,400 | 前日比 | 1,600 |
| 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。

<< 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は、前日比横ばいの86兆6,000億円(当座預金残高見込は111兆1,000億円)。無担O/Nは0.071%の出合いで立ち上がり、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。税揚げ日を越えたことで昨日より調達意欲は薄く、一巡後は0.07~0.065%中心の出合いへと推移した。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、証券業態によるロール案件の出合いが散見された。

<< 5日のオープン市場動向 >>
現先レートは低位横ばい圏で推移。短国市場は6M物の入札が実施され、WI取引の段階から0.033%と強めの出合いが見られていたこともあり、平均落札利回0.0357%、最高落札利回0.0337%と強めの結果になった。セカンダリーではショートカバーから0.030%まで買い進まれた。CP市場は、石油、電機業態によるまとまった発行もあり総額1,200億円程度の出合い。発行レートは概ね横ばいで推移した。CP等買入オペは前回より1,000億円増額されたものの、玉処分ニーズからレートは上昇。按分レート0.088%、平均落札レート0.092%、按分比率44.2%の結果となった。

<< 6日の材料 >>
*MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
*ECB定例理事会(金融政策発表あり)
*米国1月の製造業新規受注・出荷・在庫
*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、3/10発行)
*30年利付国債入札(6,000億円、3/20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 | 日経平均株価(終値) | 為替(9時) | 102.21-22 |
|-------------|------------------|--------|-----------|
| 0.610 0.030 | 14,897.63 176.15 | 為替(5時) | 102.23-24 |

| 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 | 2/28 | 3/3 | 3/4 | 3/5 |
| 日銀当預残 | 1,135,200 | 1,129,800 | 1,140,300 | 1,119,000 | 1,109,900 | 1,110,800 |
| 準備預金残 | 1,018,300 | 1,014,400 | 1,033,000 | 1,005,500 | 996,300 | 995,400 |
| レート | 0.079% | 0.073% | 0.072% | 0.074% | 0.074% | 0.078% |
| 月中平均 | 0.07577% | 0.07567% | 0.07554% | 0.07267% | 0.07300% | 0.07400% |

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す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