

**<<資金需給>>**

単位 億円

	7日需給速報		10日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 500	900	1,000
財政		11,500	▲ 32,500	1,000
資金過不足		11,000	▲ 31,600	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			3,400	
160,417			▲ 3,200	
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		9,400		2,900
CP等買入			4,400	
		▲ 300	▲ 900	
貸出支援基金		6,300		
(成長) 33,429				
(増加) 50,859		▲ 7,500		
被災地支援				
3,805				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入		100		
国債補完供給				
小計		7,900	3,700	22,900
当預増減		18,900	▲ 27,900	24,900

当座預金残高	1,131,000	3/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,019,100		23,100
積み終了先	895,700	3/10以降の残り所要積立額	
超過準備	895,700	積数	13,100
非準備先残高	111,900	1日平均	2,200
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,686,700		
準備預金進捗率	99.22% (実績)	78.57% (日数)	

3/6のマナターベース		2,017,400	
3/6コール	合計	167,403	無担 65,423 有担 101,980
コール前日増減	計	▲ 1,093	無担 ▲ 1,067 有担 ▲ 26

3/7の加重平均レート(速報)				3/6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
0.060 ~0.145 (0.073)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.055 ~0.145 (0.075)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.100 ~0.120 (0.100)				T/N	0.070 ~0.120 (0.073)		
0.100 (0.100)				S/N			
0.116 ~0.117 (0.116)				1W	0.075 ~0.150 (0.113)		
0.078 (0.078)				2W			
0.118 (0.118)				3W	0.118 (0.118)		
0.077 (0.077)		0.08-0.13	-	1M	0.200 (0.200)	有担先日付分	
		0.08-0.13	0.02-0.03	2M			
		0.08-0.13	0.02-0.025	3M	0.180 (0.180)		
		-	0.02-0.025	6M			
		-	-	1Y			

<< 3/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,103,100	前日比	▲ 27,900
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。

<< 7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89兆8000億円(当座預金残高見込は113兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは大手行から0.06~0.065%、地銀および信託業態から0.07%近辺の調達希望から始まった。取引の立ち上がりの水準は0.072%中心となったほか、本日も一部業態から試し取りの動きが見られた。出し取り一巡後も0.07%付近での散発的な取引で推移。午後は調整程度の取引に終始し、本日の取引を終了した。ターム物は、大手行から月内物0.118%で調達が見られた。

<< 7日のオープン市場動向 >>  
 現先レートは発行要因から小幅上昇。短国市場は短国買入オペが20,000億円実施され、平均利回較差▲0.004%、按分利回較差▲0.007%と品薄感が強い中、堅調な結果となった。オペ後は3Mが0.025%、6Mが0.020~0.025%で散発的な出合いが見られた。CP市場は、不動産、ノンバンク業態によるまとまった発行もあり、総額1,500億円程度の出合い。発行レートは概ね横ばいで推移。

<< 10日の材料 >>  
 \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、11日まで)  
 \*10-12月期のGDP2次速報(市場予想：前期比年率：+1.0%)  
 \*1月の国際収支 \*2月の景気ウォッチャー調査

JGB新発10年債	0.625	0.010	日経平均株価(終値)	15,274.07	139.32	為替(9時)	103.06-07
						為替(5時)	102.88-90

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	2/28	3/3	3/4	3/5	3/6	3/7
日銀当預残	1,140,300	1,119,000	1,109,900	1,110,800	1,112,100	1,131,000
準備預金残	1,033,000	1,005,500	996,300	996,500	997,900	1,019,100
レート	0.072%	0.074%	0.074%	0.078%	0.075%	0.073%
月中平均	0.07554%	0.07267%	0.07300%	0.07400%	0.07417%	0.07400%

**<<オペ情報、入札結果>>**

国短買入	20,000億円	3/11	応札	40,940億円	落札	20,003億円	按分利回り較差	-0.007%	42.9%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	1,100億円	3/11	応札	2,396億円	落札	1,102億円	按分利回り較差	-0.002%	60.9%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	1,800億円	3/11	応札	4,487億円	落札	1,804億円	按分利回り較差	0.013%	27.8%	平均利回り較差	0.017%

「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