

<<資金需給>>

単位 億円

	11日需給速報		12日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		800	300	0
財政		1,100	▲ 2,200	2,000
資金過不足		1,900	▲ 1,900	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
160,557				
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		3,200	9,200	
CP等買入		▲ 400	▲ 300	
貸出支援基金(成長)				
33,429				
(増加) 50,859				
被災地支援				
3,805				
社債等買入		▲ 200		
ETF買入		100		
国債補完供給				
小計		22,700	8,900	0
当預増減		24,600	7,000	2,000

当座預金残高	1,126,400	3/11以降の残り所要積立額	9,200
準備預金残高	1,009,600	3/12以降の残り所要積立額	
積み終了先	889,000	積数	6,500
超過準備	888,500	1日平均	1,600
非準備先残高	116,800		
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	99.61% (実績)	85.71% (日数)	

3/10のマネタリーベース		2,006,700	
3/10コール	合計	174,553	無担 68,601 有担 105,952
コール前日増減	計	3,004	無担 2,665 有担 339

3/11の加重平均レート(速報)				3/10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
0.050 ~0.145 (0.075)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.055 ~0.145 (0.075)			0.040 ~0.050 (0.041)
0.070 ~0.121 (0.083)				T/N	0.071 ~0.125 (0.088)		
0.130 (0.130)				S/N	0.125 (0.125)		
0.075 ~0.200 (0.123)				1W	0.117 ~0.400 (0.142)		
0.118 ~0.330 (0.128)				2W	0.330 (0.330)		
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.024-0.025	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 3/13~3/20 (7日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.580%
J-REIT買入 3億円 約定日 3/11

<<日銀金融政策決定会合・結果>>	
・マネタリーベースが、年間約60~70兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(全員一致)	
・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。	
①長期国債について、保有残高が年間約50兆円に相当するペースで増加し、平均残存期間が7年程度となるよう買入れを行う。	
②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約1兆円、年間約300億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。	
③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。	

「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。」

<< 3/12の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,133,400	前日比	7,000
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。

<< 11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2兆円増加の89兆2,000億円(当座預金残高見込は112兆7,000億円)。無担O/Nは0.072%の出合いが立ち上がり、大手行から0.06%、地銀および信託業態から0.07%前後の調達希望が始まった。調達意欲は強くないものの、一巡後以降も0.07%近辺での出合いが散見された。また、一部業態から試し取りと思われる調達が0.12%前後で行われた。ターム物は、引き続きロール案件による出合いが散見された。米ドル資金供給オペが1W物でオファーされ、100万ドルの落札となった。日銀金融政策決定会合において現状維持が発表された。

<< 11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、日銀政策決定会合が市場予想通り現状維持となったこともあって、全般的に閑散。3M近辺は、午前中0.023%売り/0.025%買い気配で推移、午後には0.024%と0.025%で出合いが見られた後、0.025%売り/0.030%買いの気配となった。CP市場は、償還総額600億円強に対して、発行件数は少なかったものの、ノンバンクよりまとまった額の発行があり、発行総額1,600億円強と上回った。レート水準は、特段目立った変化もなく概ね横ばい圏で推移した。

<< 12日の材料 >>
*日銀金融経済月報
*1月の第3次産業活動指数 *1-3月期の法人企業景気予測調査季報
*2月の企業物価指数 *2月の消費動向調査
*米国2月の財政収支
*流動性供給入札(3,000億円、3/14発行)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	103.25-27
0.625 0.000	15,224.11 103.97	為替(5時)	103.19-20

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	3/4	3/5	3/6	3/7	3/10	3/11
日銀当預残	1,109,900	1,110,800	1,112,100	1,131,000	1,101,800	1,126,400
準備預金残	996,300	996,500	997,900	1,019,100	987,500	1,009,600
レート	0.074%	0.078%	0.075%	0.073%	0.075%	0.075%
月中平均	0.07300%	0.07400%	0.07417%	0.07378%	0.07390%	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