

**<<資金需給>>**

単位 億円

	6日需給速報		9日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	1,400	1,000
財政		5,000	▲ 8,500	▲ 3,000
資金過不足		4,700	▲ 7,100	▲ 2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,000	
65,790			▲ 1,400	
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		11,700		10,300
CP等買入				
		▲ 300	▲ 300	
貸出支援基金		8,600		
(成長) 46,898				
(増加) 189,789		▲ 6,200		
被災地支援				
3,252				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給		200		
小計		14,000	▲ 700	10,300
当預増減		18,700	▲ 7,800	8,300

当座預金残高	1,825,600	3/6以降の残り所要積立額	10,000
準備預金残高	1,657,800	3/9以降の残り所要積立額	7,900
積み終了先	1,370,600	積数	1日平均
超過準備	1,370,600		1,100
非準備先残高	167,800		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,777,500		
準備預金進捗率	99.56%	(実績)	75.00% (日数)

3/5のマナターベース		2,745,500	
3/5コール	合計	217,757	無担 89,751 有担 128,006
コール前日増減	計	7,320	無担 5,829 有担 1,491

3/6の加重平均レート(速報)				3/5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 ~0.130 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.130 (0.080)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.074 ~0.120 (0.078)				T/N	0.074 ~0.120 (0.077)		
				S/N			
0.077 ~0.260 (0.106)				1W 0.117 (0.117)	0.075 ~0.117 (0.115)		
				2W	0.121 (0.121)		
				3W			
		0.08-0.13	-	1M	0.080 ~0.150 (0.115)		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	0-0.002	3M			
		-	▲0.013-▲0.006	6M			
		-	-	1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債買入	3,000億円	3/10	応札	7,158億円	落札	3,002億円	按分利回り較差	-0.005%	43.3%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	3,500億円	3/10	応札	9,554億円	落札	3,503億円	按分利回り較差	0.000%	3.2%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,400億円	3/10	応札	4,248億円	落札	2,408億円	按分利回り較差	-0.010%	85.7%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	1,400億円	3/10	応札	3,142億円	落札	1,403億円	按分利回り較差	-0.033%	64.8%	平均利回り較差	-0.025%
CP買入	5,000億円	3/11	応札	13,125億円	落札	4,991億円	按分レート	0.093%	47.9%	平均落札レート	0.095%
T-Bill6M	応札20兆2,620億3,000万円	落札3兆2,325億5,000万円(非競争入札:2,674億円)	3/10~9/10	▲0.0019%	按分20.1226%	平均▲0.0059%					

「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

3/9の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,817,800	前日比	▲ 7,800
O/N	0.06~0.08	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.07%台前半の出合いが中心になると見込まれる。

**<< 6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、前日比1兆4,000億円増の137兆1,000億円(当座預金残高見込みは182兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.074~0.076%での調達で始まった。一部で0.07%台後半の出合いも見られたが、一巡後は、0.073~0.075%で落ち着いた展開となり本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W物0.117%での調達が見られた。

**<< 6日のオープン市場動向 >>**  
現先S/Nは低位横ばい圏で推移した。短国市場は6M物の入札が実施され、落札結果は平均落札利回▲0.0059%、按分利回▲0.0019%と強めの結果になった。CP市場は、五・十日に係る発行となり、鉄鋼業態からのまとまった発行案件が見られ、発行額は3,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動き。CP等買入オペが実施され、平均落札利回0.095%・按分落札利回0.093%と前回比で按分・落札共に小幅上昇の結果となった。

**<< 9日の材料 >>**  
\*中曾日銀副総裁、愛媛県金融経済懇話会にて講演  
\*10-12月期のGDP2次速報(市場予想:前期比年率+2.2%)  
\*1月の国際収支 \*2月の景気ウォッチャー調査  
\*米国2月のFRB労働市場情勢指数

JGB新発10年債	0.390	0.010	日経平均株価(終値)	18,971.00	219.16	為替(9時)	120.06-07
						為替(5時)	120.10-12

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	2/27	3/2	3/3	3/4	3/5	3/6
日銀当預残	1,848,600	1,825,200	1,839,800	1,802,000	1,806,900	1,825,600
準備預金残	1,687,200	1,660,500	1,674,800	1,639,300	1,640,500	1,657,800
レート	0.074%	0.075%	0.075%	0.075%	0.080%	0.075%
月中平均	0.07532%	0.07450%	0.07467%	0.07475%	0.07580%	0.07550%