

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想	12日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		800	400	0
財政		▲ 8,100	1,300	▲ 1,000
資金過不足		▲ 7,300	1,700	▲ 1,000
貸出			▲ 100	
売出手形				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
65,430				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			10,000	
国庫短期証売却				
国債買入		10,700		
CP等買入			5,000	
		▲ 900	▲ 700	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 189,789				
被災地支援				
3,252				
社債等買入			▲ 100	
ETF買入		200	200	
国債補完供給	即日	▲ 300		
		400	300	
小計		10,100	14,600	0
当増減		2,800	16,300	▲ 1,000

当座預金残高	1,819,800	3/10以降の残り所要積立額	6,100
準備預金残高	1,662,600	3/11以降の残り所要積立額	4,100
積み終了先	1,370,900	積数	800
超過準備	1,370,900	1日平均	800
非準預先残高	157,200		
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	99.77% (実績)	82.14% (日数)	

3/9のマネタリーベース		2,754,600	
3/9コール 合計	219,245	無担	88,288
有担	130,957		
コール前日増減	計	4,488	無担
有担	1,194	有担	3,294

3/10の加重平均レート(速報)				3/9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 ~0.130 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.130 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.070 ~0.125 (0.082)				T/N		0.072 ~0.125 (0.087)	
0.125 (0.125)				S/N		0.125 (0.125)	
0.075 ~0.120 (0.098)				1W		0.117 ~0.118 (0.117)	
0.118 ~0.310 (0.149)				2W			
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.005-0.000	3M			
		-	▲0.013-▲0.010	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 4,798億円 3/10 ~ 3/11 (1日間) 応札 259億円 落札 259億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 3/12~3/19 (7日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.630%
 流動性供給 応札 6,037億円 落札 2,995億円 3/12 募入最大利回較差 0.028% 按分 79.2746% 募入平均利回較差 0.013%
 J-REIT買入 12億円 約定日 3/11

<< 3/11の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,836,100	前日比	16,300
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。

<< 10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1兆2,000億円増の137兆4,000億円(当座預金残高見込みは181兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.073~0.075%での調達で始まった。出合い一巡後は、レート水準を引き下げ、0.07~0.073%で散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。また、本日も複数の邦銀から0.125%での試し取りが行われた。ターム物は、大手行から1W物0.117%での調達が見られた。

<< 10日のオープン市場動向 >>
 短国現先レートS/Nは前日から横ばいでの推移となった。オペや入札といったイベントが無い中、相場は全体的に堅調で、3M:▲0.005~0.00%、6M:▲0.013~▲0.010%の出合いが見られた。CP市場は、鉄鋼業態からの大型発行案件が見られたものの、償還総額1,000億円程度に対して発行額は900億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

<< 11日の材料 >>
 *1月の機械受注統計(市場予想: 船舶・電力除く民需、前月比▲4.1%)
 *2月の企業物価指数
 *1月の特定サービス産業動態統計速報
 *米国2月の財政収支

JGB新発10年債	0.465	0.035	日経平均株価(終値)	18,665.11	▲ 125.44	為替(9時)	121.42-44
						為替(5時)	121.78-80

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	3/3	3/4	3/5	3/6	3/9	3/10
日銀当預残	1,839,800	1,802,000	1,806,900	1,825,600	1,817,000	1,819,800
準備預金残	1,674,800	1,639,300	1,640,500	1,659,900	1,658,000	1,662,600
レート	0.075%	0.075%	0.080%	0.075%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07467%	0.07475%	0.07580%	0.07550%	0.07556%	0.07560%

「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