

**《資金需給》**

単位 億円

	13日需給速報		16日需給予想		17日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	1,200	1,000		
財政		3,500	▲ 6,800	3,000		
資金過不足		3,200	▲ 5,600	4,000		
貸出						
売出手形						
0						
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		4,600				
CP等買入						
		▲ 200	▲ 400			
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			▲ 200			
ETF買入		200	300			
国債補完供給	即日	▲ 200	200			
小計		4,400	▲ 100	10,000		
当預増減		7,600	▲ 5,700	14,000		

当座預金残高	1,841,400	3/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,678,000		1,400
積み終了先	1,388,200	3/16以降の残り所要積立額	
超過準備	1,387,700	積数	1,971,500
非準預先残高	163,400	1日平均	63,600
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)			1,777,500
3月の新所要見込		63,600	(一日平均)

3/12のマナターベース		2,770,000	
3/12コール合計	220,004	無担	88,861
有担	131,143		
コール前日増減	計	▲ 6,429	無担 ▲ 7,482
			有担 1,053

3/13の加重平均レート(速報)			3/12の加重平均レート(確報)			単位(%)
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
0.050 ~0.130 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.130 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.075 ~0.087 (0.077)				T/N	0.070 ~0.120 (0.078)	
				S/N		
0.070 ~0.260 (0.114)				1W	0.117 ~0.121 (0.117)	
0.114 (0.114)				2W	0.118 (0.118)	
				3W		
		0.08-0.13	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	-	3M		
		-	▲0.013-▲0.012	6M		
		-	-	1Y		

**《オペ情報、入札結果》**

国債補完	2,000億円	3/13	~ 3/16 (3日間)	応札	91億円	落札	91億円	-0.400%	全取	平均	-0.400%(即)	
国債補完	2,000億円	3/13	~ 3/16 (3日間)	応札	82億円	落札	82億円	-0.400%	全取	平均	-0.400%(即)	
国短買入	10,000億円	3/17		応札	31,962億円	落札	10,002億円	按分利回り較差	0.001%	75.4%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	3,000億円	3/20		応札	8,412億円	落札	3,003億円	按分利回り較差	-0.007%	94.1%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	3,500億円	3/20		応札	8,937億円	落札	3,501億円	按分利回り較差	-0.002%	19.7%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	4,000億円	3/20		応札	10,322億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	0.011%	37.0%	平均利回り較差	0.015%

3/16の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,835,700	前日比	▲ 5,700
O/N	0.06~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.075%前後の出合いが中心になると見込まれる。					

**《 13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1兆1,000億円増の139兆円(当座預金残高見込みは184兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.075~0.076%での調達で始まった。週末要因により、前日までと比べてやや強めの展開で始まったが、一巡後は0.07%台前半で散発的に出合う程度で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。

**《 13日のオープン市場動向 》**

短国現先レートS/Nは、短国買入オペの影響で小幅低下した。短国アウトライト市場では6M▲0.013~▲0.012%の出合いが見られた。短国買入オペは10,000億円の通知に対し、平均、按分利回り較差共に+0.001%、按分比率75.1%という結果であった。CP市場は、償還総額700億円程度に対し、発行総額800億円程度。食料品業態からのまとまった発行案件が見られた。発行レートは一部の期越償還物で小幅に低下した。

**《 16日の材料 》**

\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、17日まで)  
\*米国2月の鉱工業生産・設備稼働率

**《コール2月積み期間分の加重平均レート》**

(土日を含む)	無担	0.07650%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07720%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	121.31-33
0.405	0.030	19,254.25	263.14
		為替(5時)	121.33-35

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	3/6	3/9	3/10	3/11	3/12	3/13
日銀当預残	1,825,600	1,817,000	1,819,800	1,835,700	1,833,800	1,841,400
準備預金残	1,659,900	1,658,000	1,665,100	1,669,000	1,673,000	1,678,000
レート	0.075%	0.076%	0.076%	0.083%	0.076%	0.075%
月中平均	0.07550%	0.07556%	0.07560%	0.07627%	0.07625%	0.07600%

「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