

◀資金需給▶

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想	14日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 300	1,000
財政		▲ 10,900	2,200	8,000
資金過不足		▲ 11,000	1,900	9,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
58,409				
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			10,000	
CP等買入		5,000		
		▲ 600	▲ 1,000	
貸出支援基金 (成長) 63,567 (増加) 271,714				
被災地支援				
3,144				
社債等買入		▲ 100	▲ 100	
ETF買入				
国債補完供給	即日	▲ 300	300	
小計		4,000	9,200	0
当預増減		▲ 7,000	11,100	9,000

◀ 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	2,593,300	前日比	11,100
O/N	▲0.02~0.001	T/N	▲0.02~0.001	S/N	▲0.02~0.001

無担O/Nは、0%前後で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、前営業日比1兆円減の190兆7,000億円(当座預金残高見込みは、258兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、昨日と同様、▲0.01%のオファーに対し、▲0.02%のビッドで始まった。その後、国内勢より▲0.01~0.001%での調達が見られ、午前の取引を終えた。午後は閑散とした状況の中、0~0.001%の調整程度の調達が数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートターム物で0%前後での出合いが散見された。共通担保資金供給オペは新規で3M物8,000億円がオファーされたが、応札は無かった。

◀ 10日のオープン市場動向 ▶

短国現先レートS/Nは前日から横ばい圏で推移した。短国3M物の入札は、W I 取引で▲0.095%で小額の出合いが見られる中、按分落札レート▲0.0802%(按分比率0.2962%)、平均落札レート▲0.0902%と、概ね事前の予想通りの結果で、セカンダリーでは▲0.09%で小額の出合いが見られた。その他では1Y物に▲0.36~▲0.35%で小額の出合いが見られた。CP市場は償還総額700億円程度に対し、発行総額200億円程度と閑散だった。発行レートは引き続き低位で推移した。

◀ 11日の材料 ▶

- \*1-3月期の法人企業景気予測調査季報
- \*1月のマネタリーサーベイ

当座預金残高	2,582,200	3/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,336,600		200
積み終了先	1,903,700	3/11以降の残り所要積立額	
超過準備	1,903,700	積数	100
非準備先残高	245,600	1日平均	0
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)			1,922,800
準備預金進捗率	99.99% (実績)		82.76% (日数)

JGB新発10年債	
-0.024	▲ 0.004

日経平均株価(終値)	
16,852.35	210.15

為替(9時)	113.23-25
為替(5時)	113.58-59

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	3/7	3/8	3/9	3/10
日銀当預残	2,549,600	2,561,700	2,557,500	2,581,300	2,589,200	2,582,200
準備預金残	2,305,100	2,313,800	2,317,300	2,338,300	2,350,000	2,336,600
レート	-0.002%	-0.001%	-0.001%	0.000%	-0.001%	-0.003%
月中平均	-0.00233%	-0.00167%	-0.00157%	-0.00138%	-0.00133%	-0.00150%

3/9のマネタリーベース		3,584,900	
3/9コール	合計	60,834	無担
コール前日増減	計	▲ 1,126	無担
		▲ 853	有担
			▲ 273

3/10の加重平均レート(速報)				3/9の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分	
▲0.04 ~0.001 (▲0.003)	0.001	(0.001)		O/N	▲0.01 ~0.001 (▲0.001)			0.001	(0.001)
0.000 ~0.001 (0.001)				T/N		0.000 ~0.001 (0.001)			
				S/N					
0.000 ~0.140 (0.029)				1W	▲0.01 ~0.001 (▲0.001)	▲0.01 ~0.001 (▲0.006)			
				2W		0.280 (0.280)			
				3W					
0.140 (0.140)			0.001-0.10	1M		0.140 (0.140)			有担先日付分
			0.001-0.10	2M					
			0.001-0.10	3M					
			-	6M					
			-	1Y					
			▲0.095-▲0.09						
			-						
			▲0.36-▲0.35						

◀オペ情報、入札結果▶

全店共通	8,000億円	3/14 ~ 6/13 (91日間)	0億円	0億円	按分	平均	(固定)
国債補完	30,000億円	3/10 ~ 3/11 (1日間) 応札	278億円	落札	278億円	-0.500%	平均 (即)
国債補完	7,920億円	3/10 ~ 3/11 (1日間) 応札	45億円	落札	45億円	-0.500%	平均 (即)

T-Bill3M 応札15兆3,118億円 落札4兆1,033億3,000万円(非競争入札:3,766億円) 3/14~6/13 ▲0.0802% 按分0.2962% 平均▲0.0902%  
 5年利付国債(表面利率0.1%) 応札8兆2,359億円 落札2兆2,922億円(I 非競争入札:2,072億円) 3/22~2021/3/20 ▲0.132% 按分71.2750% 平均▲0.142%

「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