

<<資金需給>>

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,300	900	0
財政		▲ 8,800	▲ 9,000	2,000
資金過不足		▲ 7,500	▲ 8,100	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		
65,430		▲ 1,400		
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
		▲ 300	▲ 900	
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				
ETF買入			200	
国債補完供給	即日	▲ 400	400	
小計		▲ 1,100	10,400	15,000
当増減		▲ 8,600	2,300	17,000

当座預金残高	1,817,000	3/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,656,100		7,900
積み終了先	1,364,000	3/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,364,000	積数	6,100
非準備先残高	160,900	1日平均	1,000
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	99.66%	(実績)	78.57% (日数)

3/6のマネターベース		2,764,500	
3/6コール合計	214,757	無担	87,094
コール前日増減	計	▲ 3,000	無担 ▲ 2,657
			有担 ▲ 343

3/9の加重平均レート(速報)			3/6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
0.060 ~0.130 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.130 (0.075)	
0.072 ~0.125 (0.087)				T/N	0.074 ~0.120 (0.078)
0.125 (0.125)				S/N	
0.117 ~0.118 (0.117)				1W	0.077 ~0.260 (0.110)
				2W	
				3W	
		0.08-0.13	-	1M	
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.003-0.002	3M	
		-	▲0.013-▲0.01	6M	
		-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	3/9	~ 3/10 (1日間)	応札	228億円	落札	228億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債補完	9,988億円	3/9	~ 3/10 (1日間)	応札	160億円	落札	160億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	10,000億円	3/11	応札	34,347億円	落札	10,001億円	按分利回り較差	0.002%	11.6%	平均利回り較差	0.003%
ETF買入	352億円	約定日	3/9								
J-REIT買入	12億円	約定日	3/9								

「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

<< 3/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,819,300	前日比	2,300
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。					

<< 9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9,000億円減の136兆2,000億円(当座預金残高見込みは181兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.074~0.075%での調達で始まった。出合い一巡後は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、本日は複数の邦銀から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。

<< 9日のオープン市場動向 >>
短国現先レート、S/Nは前日比やや低下した。短国買入オペは10,000億円の通知に対し、按分利回り較差+0.002%(按分比率11.6%)、平均利回り較差+0.003%という結果となった。オペの影響はあまり見られず、短国アウトライイト市場は3M:▲0.003~0.002%、6M:▲0.013~▲0.01%の出合いとなっていた。CP市場は、機械・石油業態からの大型発行が見られたものの、発行案件は少なく、償還総額1,600億円程度に対して発行額は800億円程度となった。発行レートは小幅に上昇した。

<< 10日の材料 >>
*2月のマネーストック
*米国1月の卸売売上高
*流動性供給入札(3,000億円、3/12発行)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.74-75
0.430	0.040	18,790.55	▲ 180.45
		為替(5時)	120.87-89

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	3/2	3/3	3/4	3/5	3/6	3/9
日銀当預残	1,825,200	1,839,800	1,802,000	1,806,900	1,825,600	1,817,000
準備預金残	1,660,500	1,674,800	1,639,300	1,640,500	1,659,900	1,656,100
レート	0.075%	0.075%	0.075%	0.080%	0.075%	0.076%
月中平均	0.07450%	0.07467%	0.07475%	0.07580%	0.07550%	0.07556%

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