

**<<資金需給>>**

単位 億円

	11日需給速報		12日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		500	0	▲1,000
財政		1,000	▲3,800	4,000
資金過不足		1,500	▲3,800	3,000
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				4,300
CP等買入				
		5,000		
		▲700	▲300	
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	100	
国債補充供給	即日	▲300		
		300	300	
小計		14,400	100	4,300
当増増減		15,900	▲3,700	7,300

当座預金残高	1,835,700	3/11以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,668,400		4,100
積み終了先	1,378,300	3/12以降の残り所要積立額	
超過準備	1,378,200	積数	2,600
非準預先残高	167,300	1日平均	600
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	99.85% (実績)		85.71% (日数)

3/10のマネタリーベース		2,756,500	
3/10コール	合計	219,499	無担 88,051 有担 131,448
コール前日増減	計	254	無担 ▲237 有担 491

3/11の加重平均レート(速報)				3/10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 ~0.125 (0.083)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.130 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.070 ~0.125 (0.089)				T/N	0.070 ~0.125 (0.082)		
0.125 (0.125)				S/N	0.125 (0.125)		
0.074 ~0.117 (0.108)				1W 0.117 (0.117)	0.075 ~0.120 (0.095)		
				2W	0.118 ~0.310 (0.149)		
				3W			
0.190 ~0.220 (0.205)		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	-	3M			
		-	▲0.015-▲0.013	6M			
		-	-	1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	2,530億円	3/11	~ 3/12 (1日間)	応札	276億円	落札	276億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	500億円	3/13	応札	1,255億円	落札	500億円	按分利回り較差	0.043%	73.7%	平均利回り較差	0.062%
国債買入	2,400億円	3/13	応札	5,219億円	落札	2,404億円	按分利回り較差	-0.019%	24.8%	平均利回り較差	-0.015%
国債買入	1,400億円	3/13	応札	3,006億円	落札	1,400億円	按分利回り較差	-0.042%	40.0%	平均利回り較差	-0.025%
J-REIT買入	12億円	約定日	3/11								

「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

3/12の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,832,000	前日比	▲3,700
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。

<< 11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1兆円増の138兆4,000億円(当座預金残高見込みは183兆6,000億円)。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、0.07~0.075%での出合いが見られるなか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。その他にも、証券業態の調達となるロール案件が複数見られた。

<< 11日のオープン市場動向 >>  
短国現先レートS/Nは引き続き低位安定で推移した。短国アウトライイト市場は前日に続いてイベントが無く、閑散。6M▲0.015~▲0.013%の出合いが見られるにとどまった。CP市場は、償還総額800億円程度に対し、発行総額は900億円程度で、発行レートは概ね横ばい圏という印象だった。

<< 12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  
\*1月の第3次産業活動指数 \*2月の消費動向調査  
\*米国2月の小売売上高 \*米国1月の企業在庫  
\*国庫短期証券入札(3ヵ月、57,000億円、3/16発行)  
\*5年利付国債入札(27,000億円、3/20発行)

JGB新発10年債	0.415	▲0.050	日経平均株価(終値)	18,723.52	58.41	為替(9時)	121.05-07
						為替(5時)	121.26-28

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	3/4	3/5	3/6	3/9	3/10	3/11
日銀当預残	1,802,000	1,806,900	1,825,600	1,817,000	1,819,800	1,835,700
準備預金残	1,639,300	1,640,500	1,659,900	1,658,000	1,665,100	1,668,400
レート	0.075%	0.080%	0.075%	0.076%	0.076%	0.083%
月中平均	0.07475%	0.07580%	0.07550%	0.07556%	0.07560%	0.07627%