

◀資金需給▶

単位 億円

	11日需給速報		14日需給予想		15日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	1,000	0		
財政		900	5,100	▲ 6,000		
資金過不足		500	6,100	▲ 6,000		
貸出						
売出手形						
本店共通						
全店共通						
共通(固定)						
国債買現						
CP買現						
国庫短期証買入				12,500		
国庫短期証売却						
国債買入		10,000		12,700		
CP等買入		▲ 1,000	▲ 400			
貸出支援基金(成長)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
ETF買入						
国債補完供給	即日	▲ 200				
小計		9,000	▲ 200	25,200		
当預増減		9,500	5,900	19,200		

当座預金残高	2,591,700	3/11以降の残り所要積立額	100
準備預金残高	2,352,600	3/14以降の残り所要積立額	0
積み終了先	1,919,900	積数	0
超過準備	1,919,900	1日平均	0
非準備先残高	239,100		
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	100.00% (実績)	93.10% (日数)	

3/10のマナターペース		3,578,000	
3/10コール合計	62,837無担	47,225有担	15,612
コール前日増減	計 2,003無担	1,496有担	507

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
▲0.01 ~0.001(▲0.001)	0.001	(0.001)		O/N ▲0.04 ~0.001 (▲0.003)		0.001	(0.001)
0.000 ~0.001 (0.001)				T/N	0.000 ~0.001 (0.001)		
				S/N			
0.050 ~0.300 (0.092)				1W 0.000	(0.000)	0.001 ~0.140 (0.043)	
▲0.005 (▲0.005)				2W			
				3W			
		0.001-0.10	-	1M	0.140	(0.140)	有担先日付分
		0.001-0.10	-	2M			
		0.001-0.10	▲0.0875	3M			
		-	▲0.16-▲0.155	6M			
		-	-	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	27,318億円	3/11	~ 3/14 (3日間)	応札	14億円	落札	14億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
国債補完	38,109億円	3/11	~ 3/14 (3日間)	応札	133億円	落札	133億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
国短買入	12,500億円	3/15	応札	28,025億円	落札	12,503億円	按分利回り較差	0.007%	20.5%	平均利回り較差	0.021%
国債買入	4,000億円	3/15	応札	12,750億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	0.031%	28.6%	平均利回り較差	0.033%
国債買入	4,200億円	3/15	応札	12,072億円	落札	4,203億円	按分利回り較差	0.026%	29.8%	平均利回り較差	0.032%
国債買入	4,500億円	3/15	応札	11,500億円	落札	4,503億円	按分利回り較差	0.018%	44.9%	平均利回り較差	0.026%

◀ 3/14の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,597,600	前日比	5,900
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。

◀ 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、前営業日比1兆4,000億円増の192兆1,000億円(当座預金残高見込みは、259兆3,000億円)。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。午後に入っても出合いのレンジは変わらず、▲0.01~0.001%の調整程度の調達が見られ、今週の取引を終えた。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。

◀ 11日のオープン市場動向 ▶
 短国現先レートS/Nはレート前日から小幅低下した。短国アウトライト市場は引き続き閑散中、3M物が▲0.0875%、6M物が▲0.16~▲0.155%で共に小額の出合いが見られた。短国買入オペは1兆2,500億円度でオファーされ、按分利回り較差+0.007%、平均利回り較差+0.021%、按分比率20.5%と、若干流れ気味の結果になった。CP市場は償還総額2,700億円程度に対し、発行総額1800億円程度で、不動産、石油、ノンバンク等の業種からまとまった発行案件があった。0%での発行が見られる等、引き続き発行レートは低位で推移した。

◀ 14日の材料 ▶
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、15日まで)
 *1月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+3.0%)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	112.84-87
-0.015	0.009	16,938.87	86.52
		為替(5時)	113.71-73

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	3/7	3/8	3/9	3/10	3/11
日銀当預残	2,561,700	2,557,500	2,581,300	2,589,200	2,582,200	2,591,700
準備預金残	2,313,800	2,317,300	2,338,300	2,350,000	2,336,700	2,352,600
レート	-0.001%	-0.001%	0.000%	-0.001%	-0.003%	-0.001%
月中平均	-0.00167%	-0.00157%	-0.00138%	-0.00133%	-0.00150%	-0.00138%

「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