

<<資金需給>>

単位 億円

	13日需給速報		14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		▲ 200	▲ 500			0
財政		▲ 100	5,300	▲ 28,000		
資金過不足		▲ 300	4,800	▲ 28,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					1,200	
160,557					▲ 8,000	
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						
CP等買入		▲ 200	▲ 1,000			
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 50,859 被災地支援 3,805						
社債等買入				1,000		
				▲ 100		
ETF買入		100				
国債補完供給						
小計		▲ 100	▲ 100	▲ 6,800		
当預増減		▲ 400	4,700	▲ 34,800		

<< 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	1,137,800	前日比	4,700
O/N	0.06~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは、0.07%前後の出合いが中心となろう。

<< 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は、前日比3,000億円増加の90兆4,000億円(当座預金残高見込は113兆4,000億円)。無担O/Nは0.072%の出合いで立ち上がり、大手行から0.06%、地銀・信託・証券業態から0.07%前後の調達希望が始まった。一巡後も0.07%近辺での出合いが散見されつつ、本日の取引を終了した。T/Nは、0.07%前後の出合いがみられた。ターム物は、ロール案件が中心の取引となった。3M物の共通担保オペが8,000億円オフアールされ、落札総額1,185億円で札割れとなった。

<< 13日のオープン市場動向 >>
 現先レートは、低位横ばい圏で推移。短国市場は、3M物の入札が実施された。W I取引で0.026~0.027%で大きく出合いが見られたが、平均落札レート0.0288%、按分落札レート0.0340%、按分比率87.5541%と、事前予想より甘めの結果となった。セカンダリー市場では、0.030~0.040%が出合い。最終気配は0.035%売り/0.040%買いとなり小甘い展開となった。CP市場は、償還総額2,600億円強に対し、石油・電気・小売業態等でまとまった案件があったものの、発行総額では2,200億円強と下回った。レート水準は、概ね横ばい圏ながらも、レートが低下した銘柄も散見された。

<< 14日の材料 >>
 *日銀金融政策決定会合議事要旨(2月17、18日開催分)
 *1月の石油等消費動向統計
 *米国2月の生産者物価指数 *米国3月のミシガン大消費者信頼感指数速報
 *5年利付国債入札(27,000億円、3/20発行)

当座預金残高	1,133,100	3/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,018,600		4,100
積み終了先	899,800	3/14以降の残り所要積立額	
超過準備	899,100	積数	1,400
非準備先残高	114,500	1日平均	700
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)			1,686,700
準備預金進捗率	99.92% (実績)		92.86% (日数)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.82-83
0.640	0.015	14,815.98	▲ 14.41
		為替(5時)	102.59-60

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	3/7	3/10	3/11	3/12	3/13
日銀当預残	1,112,100	1,131,000	1,101,800	1,126,400	1,133,500	1,133,100
準備預金残	997,900	1,019,100	987,500	1,009,900	1,019,100	1,018,600
レート	0.075%	0.073%	0.075%	0.075%	0.075%	0.073%
月中平均	0.07417%	0.07378%	0.07390%	0.07400%	0.07408%	0.07400%

3/12のマネタリーベース				2,037,000		
3/12コール	合計	166,158	無担	62,526	有担	103,632
コール前日増減	計	▲ 6,979	無担	▲ 8,448	有担	1,469

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	
0.060 ~0.145 (0.073)	0.040 ~0.050 (0.041)					0.055 ~0.145 (0.075)		0.070 ~0.125 (0.080)	0.040 ~0.050 (0.041)		
0.070 ~0.120 (0.074)								0.125 (0.125)			
0.075 ~0.150 (0.115)								0.130 (0.130)			
								0.118 (0.118)			
0.100 ~0.250 (0.168)				0.08-0.13	-				有担先日付分		
0.180 (0.180)				0.08-0.13	-						
				0.08-0.13	0.026-0.040						
				-	-						
				-	-						

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	3/17	~	6/9 (84日間)	応札	1,185億円	落札	1,185億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	4,000億円	3/20	応札	13,585億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.013%	40.5%	平均利回り較差	0.016%	
国債買入	1,700億円	3/20	応札	6,330億円	落札	1,706億円	按分利回り較差	0.016%	66.7%	平均利回り較差	0.018%	
T-Bill3M	応札22兆5,498億円		落札	5兆1,992億7,000万円(非競争入札:4,707億円)	3/17~6/16	0.0340%	按分87.5541%	平均0.0288%				

「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り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