

◀資金需給▶

単位 億円

	14日需給速報		17日需給予想	18日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 500	1,000	▲ 1,000
財政		5,500	▲ 29,500	2,000
資金過不足		5,000	▲ 28,500	1,000
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				20,000
国庫短期証売却				
国債買入				
CP等買入		▲ 1,000	▲ 700	
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		900		
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		▲ 100	▲ 7,400	20,000
当預増減		4,900	▲ 35,900	21,000

当座預金残高	1,138,000	3/14以降の残り所要積立額	1,400
準備預金残高	1,030,900	3/17以降の残り所要積立額	
積み終了先	912,000	積数	1,159,500
超過準備	911,300	1日平均	38,700
非準備先残高	107,100	積立期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,686,700
3月の新所要見込	60,300	(一日平均)	

3/13のマネタリーベース		2,036,800	
3/13コール	合計	166,083	無担 61,812 有担 104,271
コール前日増減	計	▲ 75	無担 ▲ 714 有担 639

3/14の加重平均レート(速報)				3/13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
0.055 ~0.120 (0.072)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.145 (0.073)			0.040 ~0.050 (0.041)
0.073 ~0.120 (0.083)				T/N			0.070 ~0.120 (0.074)
				S/N			
				1W			0.075 ~0.150 (0.115)
				2W			
				3W			
0.250 (0.250)		0.08-0.13	-	1M	0.250 (0.250)	0.100 ~0.220 (0.140)	有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M		0.180 (0.180)	
		0.08-0.13	0.035-0.038	3M			
		-	0.0240	6M			
		-	-	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債買入 20,000億円 3/18 応札 45,483億円 落札 20,005億円 按分利回り較差 0.002% 90.9% 平均利回り較差 0.004%

貸出増加支援 3/18~2015/3/18 (365日間) 貸付予定総額 15,760億円 貸付利率 0.10%

貸出増加支援 3/18~2016/3/18 (731日間) 貸付予定総額 100億円 貸付利率 0.10%

貸出増加支援 3/18~2017/3/17 (1,095日間) 貸付予定総額 18,793億円 貸付利率 0.10%

5年利付国債(表面利率0.2%) 応札9兆3,506億円 落札2兆4,567億円(I非競争入札:2,399億円) 3/20~2019/3/20 0.204% 按分81.0187% 平均0.204%

ETF買入 118億円 約定日 3/14

J-REIT買入 3億円 約定日 3/14

◀ 3/17の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,102,100	前日比	▲ 35,900
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。

◀ 14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6,000億円増加の91兆円(当座預金残高見込は113兆8,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは0.071%の出合いで、大手行から0.06~0.065%、地銀・信託・証券業態から0.07%前後の調達希望が始まった。積みの実質的な最終日であったが取り上げる動きはみられず、一巡後も0.07%近辺での出合いが散見される中で、本日の取引を終了した。ターム物は、証券業態のロール案件が中心の取引となった。

◀ 14日のオープン市場動向 ▶

現先レートは、横ばい圏で推移した。短国市場は、短国買入オペが2兆円で実施され、平均利回較差+0.004%、按分利回較差+0.002%、按分比率90.9%と小甘い結果になった。セカンダリー市場は、新発3Mで0.035~0.038%、6Mで0.024%の出合いが見られた。CP市場は、償還総額1,600億円強に対し、電気・石油業態よりまとまった額の発行があったものの、発行件数は少なく、発行総額は900億円を下回った。利回水準は、特段目立った変化もなく落ち着いて推移した。

◀ 17日の材料 ▶

- \*月例経済報告
- \*米国2月の鉱工業生産・設備稼働率
- \*ユーロ圏2月の消費者物価指数改定値

◀コール2月積み期間分の加重平均レート▶			
(土日を含む)	無担	0.07507%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07555%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	0.620	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	14,327.66	▲ 488.32	為替(9時)	101.78-79
						為替(5時)	101.76-78

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	3/7	3/10	3/11	3/12	3/13	3/14
日銀当預残	1,131,000	1,101,800	1,126,400	1,133,500	1,133,100	1,138,000
準備預金残	1,019,100	987,500	1,009,900	1,019,100	1,019,100	1,030,900
レート	0.073%	0.075%	0.075%	0.075%	0.073%	0.072%
月中平均	0.07378%	0.07390%	0.07400%	0.07408%	0.07400%	0.07363%

「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