

《資金需給》

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想		19日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		900	▲ 200	▲ 2,000		
財政		▲ 32,300	5,800	3,000		
資金過不足		▲ 31,400	5,600	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				
153,740		▲ 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		▲ 700	▲ 200			
貸出支援基金(成長) 33,429(増加) 50,859			34,700			
被災地支援						
3,805						
社債等買入						
ETF買入		100	100			
国債補完供給						
小計		▲ 7,400	54,600	0		
当預増減		▲ 38,800	60,200	1,000		

当座預金残高	1,099,200	3/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	993,500		1,159,500
積み終了先	396,100	3/18以降の残り所要積立額	
超過準備	320,500	積数	611,300
非準備先残高	105,700	1日平均	21,100
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,870,000		
準備預金進捗率	67.31% (実績)	6.45% (日数)	

3/14のマネタリーベース		2,042,200	
3/14コール	合計	163,207	無担 63,007 有担 100,200
コール前日増減	計	▲ 2,876	無担 1,195 有担 ▲ 4,071

3/17の加重平均レート(速報)				3/14の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.030 ~0.145 (0.074)	0.040	~0.050 (0.041)		O/N	0.055 ~0.120 (0.072)		有担当日分
0.070 ~0.120 (0.078)				T/N		0.073 ~0.120 (0.083)	
				S/N			
0.110 ~0.400 (0.121)				1W			
				2W			
				3W			
0.305 (0.305)		0.08-0.13	0.02-0.025	1M	0.250	(0.250)	有担先日付分
		0.08-0.13	0.02-0.025	2M			
		0.08-0.13	-	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

《オペ情報、入札結果》

CP買入	5,000億円	3/20	応札	9,544億円	落札	4,118億円	按分レート	0.082%	96.5%	平均落札レート	0.086%
国債買入	2,500億円	3/20	応札	10,148億円	落札	2,500億円	全取利回り較差	0.005%		平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,500億円	3/20	応札	12,083億円	落札	2,504億円	按分利回り較差	0.001%	38.3%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	3/20	応札	13,902億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.006%	95.6%	平均利回り較差	-0.004%
ETF買入	118億円	約定日	3/17								

「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

《 3/18の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,159,400	前日比	60,200
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。

《 17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3兆6,000億円減少の87兆4,000億円(当座預金残高見込みは110兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06~0.065%、地銀・信託業態等から0.071%前後での調達希望。積み期間の初日となるが、地合いに目立った変化は無く、一日を通して0.07%前後の出合いが中心となった。また、一部では調達訓練と見られる0.12%近辺での出合いも散見された。ターム物では、1Wの期間で大手行によるまとまった調達が確認された。

《 17日のオープン市場動向 》
 現先レートは短国・CP共に低位安定。短国市場は、入札ラッシュを控えて様子見姿勢が強く閑散な地合い。CP市場は、発行総額650億円程度となった。発行レートは横ばい圏での動き。また、本日はCP等買入オペが実施された。市場での売却ニーズが強い銘柄の大半が応札できなかったため、結果は平均落札利回0.086%、按分落札利回0.082%と前回比でレート低下となった。

《 18日の材料 》
 *米国FOMC(1日目)
 *米国2月の消費者物価指数 *米国2月の住宅着工件数
 *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、3/20発行)
 *20年利付国債入札(12,000億円、3/20発行)

《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	0.000	日経平均株価(終値)	14,277.67	▲ 49.99	為替(9時)	101.36-37
						為替(5時)	101.56-57

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	3/10	3/11	3/12	3/13	3/14	3/17
日銀当預残	1,101,800	1,126,400	1,133,500	1,133,100	1,138,000	1,099,200
準備預金残	987,500	1,009,900	1,019,100	1,019,100	1,031,100	993,500
レート	0.075%	0.075%	0.075%	0.073%	0.072%	0.074%
月中平均	0.07390%	0.07400%	0.07408%	0.07400%	0.07363%	0.07365%