

《資金需給》

単位 億円

	18日需給速報		19日需給予想	20日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	▲ 1,600	▲ 2,000
財政		6,800	6,600	59,000
資金過不足		6,500	5,000	57,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
153,740				
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				14,700
CP等買入				4,100
貸出支援基金(成長)		▲ 200	▲ 100	
(増加) 85,512		34,700		
被災地支援				
3,805				
社債等買入			▲ 100	
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		54,600	▲ 100	18,800
当預増減		61,100	4,900	75,800

当座預金残高	1,160,300	3/18以降の残り所要積立額	611,500
準備預金残高	1,049,800	3/19以降の残り所要積立額	402,700
積み終了先	747,100	積数	402,700
超過準備	716,100	1日平均	14,400
非準備先残高	110,500	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	78.47% (実績)		9.68% (日数)

3/17のマナターベース		2,002,500	
3/17コール	合計	165,918	無担 60,692 有担 105,226
コール前日増減	計	2,711	無担 ▲ 2,315 有担 5,026

3/18の加重平均レート(速報)				3/17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
0.030 ~0.125 (0.080)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.030 ~0.145 (0.074)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.072 ~0.120 (0.085)					0.070 ~0.120 (0.078)		
					0.110 ~0.400 (0.120)		
0.075 ~0.200 (0.119)							
		0.08-0.13	-	1M	0.305 (0.305)		有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.03-0.032	3M			
		-	-	6M			
		-	0.033-0.035	1Y			

《オペ情報、入札結果》

国債補完 2,000億円 3/18 ~ 3/19 (1日間) 応札 3億円 落札 3億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)  
 米ドル資金供給(固定金利方式) 3/20~3/27 (7日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.580%  
 T-Bill1Y 応札15兆3,326億円 落札2兆3,136億円(非競争入札:1,863億5,000万円) 3/20~2015/3/20 0.0380% 按分95.0789% 平均0.0350%  
 20年利付国債(表面利率1.5%) 応札4兆517億円 落札1兆978億円(I非競争入札:1,017億円) 3/20~2034/3/20 1.542% 按分96.0187% 平均1.527%

「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

《 3/19の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,165,200	前日比	4,900
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。

《 18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5兆2,000億円増加の92兆6,000億円(当預金残高見込は115兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06~0.065%、地銀・信託・証券業態などから0.07%前後での調達希望。立ち上がりは0.07%前後の出合いが中心となったものの、地銀を中心に調達意欲はやや弱めで、一巡後には0.065%での出合いも見られた。また、一部では試し取りと見られる0.12%近辺での出合いも確認された。ターム物は、1W物で大手行によるまとまった調達が確認された。

《 18日のオープン市場動向 》  
 現先はT/N・S/N共に低位安定。短国市場は、1Y物(438回)入札が実施された。落札結果は、様子見姿勢の強まりから平均落札利回0.035%、按分落札利回0.038%とややテールが流れた。セカンダリーでは0.033~0.035%での出合いが見られるなど、小じっかりとした地合い。CP市場は、5・10日発行となったことで発行総額は2,300億円程度(同償還総額2,900億円弱)となった。発行期間は依然として期内物が多く、発行レートは横ばい圏での動きとなった。

- 《 19日の材料 》
- \*1月の景気動向指数改訂状況 \*2月の貿易統計
  - \*黒田日銀総裁、国際通貨研究所主催・国際金融シンポジウムにて講演
  - \*木内日銀審議委員、滋賀県金融経済懇談会にて講演
  - \*佐藤日銀審議委員、ジャパン・ソサエティNYにて講演
  - \*米国FOMC(2日目) \*ECB定例理事会(1日目、金融政策発表なし)
  - \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、3/24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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.90-92
0.620 0.000	14,411.27 133.60	為替(5時)	101.64-65

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	3/11	3/12	3/13	3/14	3/17	3/18
日銀当預残	1,126,400	1,133,500	1,133,100	1,138,000	1,099,200	1,160,300
準備預金残	1,009,900	1,019,100	1,019,100	1,031,100	993,500	1,049,800
レート	0.075%	0.075%	0.073%	0.072%	0.074%	0.080%
月中平均	0.07400%	0.07408%	0.07400%	0.07363%	0.07365%	0.07400%