

<<資金需給>>

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想		24日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,700	▲ 2,800	▲ 1,000		
財政		7,900	52,700	17,000		
資金過不足		6,200	49,900	18,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					1,700	
153,740					▲ 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			15,100	1,900		
CP等買入			4,100			
		▲ 100	▲ 700			
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512 被災地支援 3,805						
社債等買入		▲ 100	▲ 300			
ETF買入		100				
国債補完供給						
小計		▲ 100	18,200	▲ 4,400		
当預増減		6,100	68,100	13,600		

当座預金残高	1,166,400	3/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,052,300		402,700
積み終了先	875,600	3/20以降の残り所要積立額	
超過準備	823,900	積数	301,000
非準預先残高	114,100	1日平均	11,100
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	83.90%	(実績)	12.90% (日数)

3/18のマネタリーベース		2,064,000	
3/18コール	合計	174,932	無担 69,266 有担 105,666
コール前日増減	計	9,014	無担 8,574 有担 440

3/19 の加重平均レート(速報)				3/18 の加重平均レート(確報)				単位 (%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.050 ~0.145 (0.077)	0.040	~0.050 (0.041)		O/N	0.030 ~0.125 (0.080)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.073 ~0.120 (0.088)				T/N		0.072 ~0.120 (0.085)		
				S/N				
0.117 ~0.150 (0.120)				1W	0.170 (0.170)	0.075 ~0.200 (0.118)		
				2W				
				3W				
0.300 (0.300)				1M				有担先日付分
				2M				
				3M				
				6M				
				1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	3/24 ~ 6/16 (84日間)	応札 1,650億円	落札 1,650億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	1,700億円	3/24	応札 5,084億円	落札 1,705億円	按分利回り較差 -0.004%	24.5%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	200億円	3/24	応札 568億円	落札 200億円	按分利回り較差 0.190円	20.0%	平均利回り較差	0.037円

T-Bill3M 応札29兆7,065億円 落札5兆2,526億6,000万円(非競争入札:4,173億円) 3/24~6/23 0.0381 % 按分67.3681% 平均0.0381%

ETF買入 118億円 約定日 3/19

「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。」

3/20の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,234,500	前日比	68,100
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。

<< 19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3,000億円減少の92兆3,000億円(当預金残高見込は116兆5,000億円)。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。一巡以降は調達意欲がやや弱まったものの、0.065%近辺では比較的厚めにビッドが残ったことから、出合いレートは一日を通して0.07%が中心となった。一部では調達訓練と見られる0.12%近辺での出合いも確認された。ターム物では、1W物で大手行によるまとまった調達が確認された。

<< 19日のオープン市場動向 >>

現先レートは、短国・CP市場共に低位安定。短国市場では、3M物入札(439回)が実施された。WI取引では0.04~0.042%でトレードがみられていたものの、落札結果は平均・按分落札利回共に0.0381%。WI取引において0.04%台で出合いが見られていた割には堅調な結果となった。セカンドラリーでは、ショートカバーから一時0.015%まで買い進まれた。CP市場は、発行総額1,300億円程度(同償還総額1,400億円程度)となった。発行レートは、総じて横ばい圏での動きとなった。

<< 20日の材料 >>

- *黒田日銀総裁、日本商工会議所第119回通常会員総会にて講演
- *米国2月の中古住宅販売
- *ECB定例理事会(2日目、金融政策発表なし)
- *国庫短期証券入札(2ヶ月、25,000億円、3/25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	0.605	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	14,462.52	51.25	為替(9時)	101.47-48
						為替(5時)	101.57-58

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	3/12	3/13	3/14	3/17	3/18	3/19
日銀当預残	1,133,500	1,133,100	1,138,000	1,099,200	1,160,300	1,166,400
準備預金残	1,019,100	1,019,100	1,031,100	993,500	1,049,800	1,052,300
レート	0.075%	0.073%	0.072%	0.074%	0.080%	0.077%
月中平均	0.07408%	0.07400%	0.07363%	0.07365%	0.07400%	0.07416%

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の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