

◀資金需給▶

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想	26日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	▲ 300	▲ 1,000
財政		▲ 13,900	19,500	3,000
資金過不足		▲ 13,800	19,200	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,700		
147,384		▲ 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		2,100	9,200	
CP等買入		▲ 600	▲ 1,000	
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				
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		▲ 4,800	8,300	20,000
当預増減		▲ 18,600	27,500	22,000

当座預金残高	1,217,200	3/24以降の残り所要積立額	148,200
準備預金残高	1,106,200	3/25以降の残り所要積立額	125,900
積み終了先	905,100	積数	125,900
超過準備	904,900	1日平均	5,700
非準備先残高	111,000		
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	93.27% (実績)	29.03% (日数)	

3/20のマネタリーベース		2,143,800	
3/20コール	合計	179,582	無担 69,412 有担 110,170
コール前日増減	計	5,318	無担 25 有担 5,293

3/24の加重平均レート(速報)				3/20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
0.045 ~0.145 (0.073)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.055 ~0.150 (0.072)			
0.070 ~0.120 (0.076)					0.065 ~0.120 (0.075)		
						0.075 ~0.117 (0.116)	
0.275 (0.275)							
0.210 (0.210)		0.08-0.13	0.0250				有担先日付分
		0.08-0.13	0.0370				
		0.08-0.13	0.0200				
		-	0.0200				
		-	0.0250-0.0275				

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	13,524億円	3/24 ~ 3/25 (1日間)	応札 3億円	落札 3億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債買入	20,000億円	3/26	応札 38,580億円	落札 20,004億円	按分利回り較差 0.000%	79.1%	平均利回り較差 0.003%
被災地支援(第35回)	3/28~2015/3/27 (364日間) 貸付予定総額 0億円 貸付利率0.10%						

「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

◀ 3/25の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,244,700	前日比	27,500
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。

◀ 24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1兆5,000億円減少の92兆9,000億円(当預金残高見込は121兆9,000億円)。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。先週末に引き続き調達意欲は限られていたものの、0.065%では底堅くビッドが入っていたことから、一巡後も0.065~0.075%の出合いを中心に推移した。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。

◀ 24日のオープン市場動向 ▶

現先S/N物は横ばい圏での動き。短国市場は短国買入オペ2兆円が実施され、平均利回較差+0.003%、按分利回較差±0.000%とほぼ市場実勢通りの結果。セカンダリー市場は堅調な地合い。CP市場では償還総額1,600億円程度に対し、発行総額は600億円程度。発行レートは特段目立った動きもなく、概ね横ばい圏での動きとなった。

◀ 25日の材料 ▶

- *米国1月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- *米国2月の新築一戸建て販売件数
- *米国3月のCB消費者信頼感指数
- *英国2月の消費者物価指数
- *流動性供給入札(3,000億円、3/27発行)

JGB新発10年債	0.605	0.010	日経平均株価(終値)	14,475.30	251.07	為替(9時)	102.27-28
						為替(5時)	102.54-55

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	3/14	3/17	3/18	3/19	3/20	3/24
日銀当預残	1,138,000	1,099,200	1,160,300	1,166,400	1,235,800	1,217,200
準備預金残	1,031,100	993,500	1,049,800	1,052,600	1,122,900	1,106,200
レート	0.072%	0.074%	0.080%	0.077%	0.072%	0.073%
月中平均	0.07363%	0.07365%	0.07400%	0.07416%	0.07378%	0.07375%