

◀資金需給▶

単位 億円

	26日需給速報		27日需給予想	28日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,100	▲ 2,200	▲ 2,000
財政		12,300	▲ 2,000	8,000
資金過不足		11,200	▲ 4,200	6,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
147,384				
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				9,000
CP等買入		▲ 300	▲ 500	
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	100	
国債補完供給		100		
小計		19,900	▲ 400	9,000
当預増減		31,100	▲ 4,600	15,000

当座預金残高	1,276,000	3/26以降の残り所要積立額	99,900
準備預金残高	1,161,800	3/27以降の残り所要積立額	81,000
積み終了先	960,300	積数	4,100
超過準備	959,100	1日平均	4,100
非準備先残高	114,200		
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	95.67% (実績)	35.48% (日数)	

3/25のマネタリーベース		2,153,100	
3/25コール	合計	178,607	無担 62,746 有担 115,861
コール前日増減	計	▲ 6,285	無担 ▲ 6,203 有担 ▲ 82

3/26の加重平均レート(速報)				3/25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
0.060 ~0.145 (0.070)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.020 ~0.085 (0.069)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.065 ~0.120 (0.071)				T/N	0.065 ~0.120 (0.075)		
				S/N			
0.070 (0.070)				1W			
				2W	0.310 ~0.330 (0.312)		
				3W			
		0.08-0.13	0.0200	1M	0.100 (0.100)	有担先日付分	
		0.08-0.13	0.0230	2M			
		0.08-0.13	0.030-0.034	3M			
		-	-	6M			
		-	0.0260	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	2,154億円	3/26	~ 3/27 (1日間) 応札	45億円	落札	45億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
CP買入	5,000億円	3/31	応札	9,595億円	落札	4,352億円	按分レート	0.075%	35.5%	平均落札レート	0.082%
国債買入	2,500億円	3/28	応札	10,591億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	0.005%	67.6%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,500億円	3/28	応札	12,629億円	落札	2,506億円	按分利回り較差	-0.002%	73.5%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	4,000億円	3/28	応札	16,337億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	0.000%	26.7%	平均利回り較差	0.002%
T-Bill3M	応札30兆3,968億円		落札5兆2,727億円(非競争入札:4,572億4,000万円)		3/28~6/30	0.0330%	按分	79.0689%	平均	0.0326%	

「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。」

◀ 3/27の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,271,400	前日比	▲ 4,600
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。

◀ 26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2兆2,000億円増加の97兆3,000億円(当預金残高見込は127兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06~0.065%、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。調達需要は弱く、一巡後は軒並み取り下がりとの動きとなり、0.065%の出合いを中心に推移した。ターム物は、証券業態によるロール案件の調達が中心となった。

◀ 26日のオープン市場動向 ▶
 現先レートは横ばい圏での動き。短国市場は期末ニーズが強く堅調に推移。3M物の入札が実施され、落札結果は平均落札利回0.0326%、按分落札利回0.0330%となった。セカンダリー市場は0.030~0.031%での推移。CP市場は償還総額3,100億円程度に対し発行総額1,400億円程度と閑散。発行レートは特段目立った変化もなく概ね横ばい圏で推移。CP等買入オペが実施され、平均落札レート0.082%、按分落札レート0.075%と前回比低下の結果となった。

◀ 27日の材料 ▶
 *米10-12月期のGDP確報値
 *2年利付国債入札(27,000億円、4/15発行)

JGB新発10年債	0.625	0.020	日経平均株価(終値)	14,477.16	53.97	為替(9時)	102.30-31
						為替(5時)	102.28-29

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	3/18	3/19	3/20	3/24	3/25	3/26
日銀当預残	1,160,300	1,166,400	1,235,800	1,217,200	1,244,900	1,276,000
準備預金残	1,049,800	1,052,600	1,122,900	1,106,300	1,127,600	1,161,800
レート	0.080%	0.077%	0.072%	0.073%	0.069%	0.070%
月中平均	0.07400%	0.07416%	0.07378%	0.07375%	0.07356%	0.07342%

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録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