

<<資金需給>>

単位 億円

	12日需給速報		13日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		0	▲ 400	1,000
財政		▲ 2,000	5,000	▲ 4,000
資金過不足		▲ 2,000	4,600	▲ 3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
65,430				
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			4,600	
CP等買入				
		▲ 300	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 189,789				
被災地支援				
3,252				
社債等買入				
ETF買入		100	200	
国債補充供給		300		
小計		100	4,600	0
当預増減		▲ 1,900	9,200	▲ 3,000

当座預金残高	1,833,800	3/12以降の残り所要積立額	2,600
準備預金残高	1,672,000	3/13以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,381,700	積数	1,400
超過準備	1,381,700	1日平均	500
非準備先残高	161,800	積み期間(2/16~3/15)の所要準備額(積数)	1,777,500
準備預金進捗率	99.92% (実績)		89.29% (日数)

3/11のマナターベース		2,772,000	
3/11コール	合計	226,433	無担 96,343 有担 130,090
コール前日増減	計	6,934	無担 8,292 有担 ▲ 1,358

3/12の加重平均レート(速報)			3/11の加重平均レート(確報)		
無担(平均)	有担(平均)	CP配a-1	短国	無担当日分	無担先日付分
0.060 ~0.130 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.083)	
0.070 ~0.120 (0.078)				T/N	0.070 ~0.125 (0.089)
				S/N	0.125 (0.125)
0.117 ~0.121 (0.117)				1W	0.074 ~0.117 (0.109)
0.118 (0.118)				2W	
				3W	
		0.08-0.13	-	1M	0.190 ~0.220 (0.205)
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.003-0.002	3M	
		-	▲0.015-▲0.014	6M	
		-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	3/12 ~ 3/13 (1日間) 応札	11億円	落札	11億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
社債買入	1,000億円	3/18 応札	1,555億円	落札	1,000億円	按分レート	0.022%	43.6%	平均落札レート 0.072%
T-Bill3M	応札26兆6,552億円	落札5兆2,272億4,000万円(非競争入札:4,427億円)	3/16~6/15	0.0020%	按分56.9515%	平均▲0.0004%			
5年利付国債(表面利率0.1%)	応札8兆9,391億円	落札2兆4,556億円(I非競争入札:2,423億円)	3/20~2020/3/20	0.126%	按分62.0503%	平均0.122%			

「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

<< 3/13の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,843,000	前日比	9,200
O/N	0.06~0.08	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.075%前後の出合いが中心になると見込まれる。

<< 12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みは、前日比5,000億円減の137兆9,000億円(当座預金残高見込みは183兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券から0.074~0.075%での調達で始まった。一巡後は、昨日と同様に0.07~0.075%で散発的に出合うなか本日の取引を終えた。また、本日も一部邦銀から0.125%での試し取りが行われた。ターム物は、大手行から1W物0.117%での調達が見られた。

<< 12日のオープン市場動向 >>
短国現先レートは、S/Nが短国の発行日にあつたものの、レートは横ばい圏であった。短国3M物の入札は按分落札レート0.002%(按分比率56.9515%)、平均落札レート▲0.0004%と、ほぼ前回並みの結果となった。セカンダリーでは▲0.003~0.002%の出合いが見られた。また、6M物は▲0.015~▲0.014%の出合いが見られた。CP市場は償還総額2,800億円程度に対して発行総額は1,400億円程度となるなど、五・十日発行にしては償還対比で少なめの発行となった。発行レートは概ね横ばいだったが、一部の期末越銘柄では小幅に低下した。

<< 13日の材料 >>
*1月の石油等消費動態統計
*米国2月の生産者物価指数
*米国3月のミシガン大消費者信頼感指数速報

JGB新発10年債	0.375	▲ 0.040	日経平均株価(終値)	18,991.11	267.59	為替(9時)	121.41-42
						為替(5時)	121.01-03

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	3/5	3/6	3/9	3/10	3/11	3/12
日銀当預残	1,806,900	1,825,600	1,817,000	1,819,800	1,835,700	1,833,800
準備預金残	1,640,500	1,659,900	1,658,000	1,665,100	1,669,000	1,672,000
レート	0.080%	0.075%	0.076%	0.076%	0.083%	0.076%
月中平均	0.07580%	0.07550%	0.07556%	0.07560%	0.07627%	0.07625%