

**<<資金需給>>**

単位 億円

	20日需給速報		23日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,000	0	0
財政		12,000	▲ 3,500	4,000
資金過不足		11,000	▲ 3,500	4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		7,600	1,100	3,900
67,367		▲ 5,700	▲ 1,000	▲ 3,800
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				15,000
国庫短期証売却				
国債買入		10,600	8,700	
CP等買入			5,000	
		▲ 700	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470				
被災地支援				
3,252				
社債等買入		▲ 300		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		11,500	13,600	15,100
当預増減		22,500	10,100	19,100

当座預金残高	1,912,700	3/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,759,800		186,500
積み終了先	1,412,300	3/23以降の残り所要積立額	
超過準備	1,399,500	積数	88,700
非準備先残高	152,900	1日平均	3,700
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,971,500		
準備預金進捗率	95.50%	(実績)	22.58% (日数)

3/19のマネタリーベース		2,826,700	
3/19コール	合計	194,840	無担 67,503 有担 127,337
コール前日増減	計	▲ 25,306	無担 ▲ 24,440 有担 ▲ 866

3/20の加重平均レート(速報)			3/19の加重平均レート(確報)			単位(%)
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
0.060 ~0.130 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.130 (0.071)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.050 ~0.130 (0.077)					0.068 ~0.120 (0.077)	
0.062 ~0.200 (0.111)					0.065 ~0.117 (0.113)	
					0.117 (0.117)	
		0.08-0.13	-			有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	0.004-0.008			
		-	-			
		-	▲0.007-▲0.002			

<< 3/23の日銀調節とレート予想 >>						
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,922,800	前日比	10,100	
O/N	0.06~0.075	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12	

無担O/Nは0.065%前後の出合いが中心になると見込まれる。

<< 20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1兆1,000億円減の142兆円(当座預金残高見込みは過去最高の191兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.065%前後での調達で始まった。一巡後は、0.06%台前半を中心に散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W物0.117%での調達が見られた。

<< 20日のオープン市場動向 >>  
 現先レートは横ばい圏での推移となった。短国買入オペは前回比5,000億円増額の15,000億円で通知された。結果は平均・按分利回較差ともに0.003%と小さい結果となった。CP市場は一部大型発行案件がみられたものの、発行総額は1,100億円程度にとどまった。発行レートは横ばいだった。

<< 23日の材料 >>  
 \*月例経済報告  
 \*米国2月の中古住宅販売

JGB新発10年債	0.325	0.000	日経平均株価(終値)	19,560.22	83.66	為替(9時)	120.75-77
						為替(5時)	120.80-82

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	3/13	3/16	3/17	3/18	3/19	3/20
日銀当預残	1,841,400	1,834,300	1,852,500	1,887,600	1,890,200	1,912,700
準備預金残	1,679,400	1,677,800	1,691,700	1,728,100	1,716,400	1,759,800
レート	0.075%	0.075%	0.075%	0.075%	0.071%	0.066%
月中平均	0.07600%	0.07594%	0.07588%	0.07583%	0.07558%	0.07427%

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	3/24	~	7/3 (101日間)	応札	3,900億円	落札	3,900億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	2,314億円	3/20	~	3/23 (3日間)	応札	29億円	落札	29億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	15,000億円	3/24	応札	36,308億円	落札	15,001億円	按分利回り較差	0.003%	93.6%	平均利回り較差	0.003%	
ETF買入	352億円	約定日	3/20									

「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