

《資金需給》

単位 億円

	23日需給速報	24日需給予想	25日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	▲ 200	▲ 1,700	▲ 2,000
財政	3,500	▲ 200	12,000
資金過不足	3,300	▲ 1,900	10,000
貸出			
売出手形	0		
本店共通	0		
全店共通	0		
共通(固定)			600
45,449			▲ 8,200
国債買現	0		
CP買現	▲ 3,900		
0			
国庫短期証買入	17,500		
国庫短期証売却			
国債買入	13,800	5,300	
CP等買入	5,000		
	▲ 200	▲ 300	
貸出支援基金(成長) 63,567(増加) 289,658			
被災地支援	3,144		
社債等買入			
ETF買入			
国債補完供給	即日 ▲ 2,400	2,400	
	1,900		
小計	31,700	7,400	▲ 7,600
当預増減	35,000	5,500	2,400

3/24の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,696,000	前日比	5,500
O/N	▲0.02~0.001	T/N	▲0.02~0.001	S/N	▲0.02~0.001

無担O/Nは0%前後での出合いが中心になると見込まれる。

《 23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1兆9,000億円増加の198兆2,000億円(当座預金残高見込みは269兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、▲0.01%のオファーに対して、▲0.02%のビッドで始まった。その後、国内勢より▲0.015~0.001%の調達で推移した。午後に入ると、0%程度での調整の調達が散見され、本日の取引を終了した。ターム物は、ショートターム物で0%前後での出合いが散見された。3M物の共通担保オベが1兆5,000億円オファーされ、結果は落札総額560億円(期落ち額8,150億円)となり、札割れとなった。

《 23日のオープン市場動向 》

現先レートは横ばいで推移した。短国市場は全般的に閑散な中、3Mが▲0.115%、1Yが▲0.23%の出合いが見られた程度であった。CP市場は25日発行となり建設、不動産、電機業態等からまとまった発行が見られ、発行総額3,100億円程度に膨らんだ。発行レートは期内物、期越物問わず0%近辺で決着した。

《 24日の材料 》

- *日銀金融政策決定会合における主な意見(3月14、15日開催分)
- *米国2月の耐久財新規受注
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、45,000億円、3/28発行)

当座預金残高	2,690,500	3/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,435,500		58,500
積み終了先	1,971,700	3/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,970,400	積数	47,100
非準備先残高	255,000	1日平均	2,000
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)			2,047,100
準備預金進捗率	97.70% (実績)		25.81% (日数)

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	112.27-28
-0.110	▲ 0.010	17,000.98	▲ 47.57	為替(5時)	112.38-39

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	3/15	3/16	3/17	3/18	3/22	3/23
日銀当預残	2,608,900	2,608,800	2,609,700	2,618,900	2,655,500	2,690,500
準備預金残	2,365,400	2,367,500	2,364,900	2,371,000	2,412,400	2,435,500
レート	-0.002%	0.002%	-0.003%	-0.002%	-0.003%	-0.004%
月中平均	-0.00147%	-0.00125%	-0.00135%	-0.00148%	-0.00155%	-0.00165%

3/22のマネタリーベース			3,654,500			
3/22コール	合計	45,450	無担	33,205	有担	12,245
コール前日増減	計	4,225	無担	4,822	有担	▲ 597

3/23の加重平均レート(速報)				3/22の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		CP配a-1	短国	無担当日分		有担当日分	
▲0.015 ~ 0.005 (▲0.004)	0.001	(0.001)				▲0.04 ~ 0.010 (▲0.003)		0.001	(0.001)
▲0.001 (▲0.001)							0.000	(0.000)	
0.117 (0.117)									
▲0.01 ~ 0.000 (▲0.009)							▲0.001 ~ 0.080 (0.023)		
							0.100	(0.100)	
0.001 (0.001)				0.001-0.10	-		0.100 ~ 0.130 (0.117)		有担先日付分
				0.001-0.10	-				
				0.001-0.10	▲0.115				
				-	-				
				-	▲0.23				

《オペ情報、入札結果》

全店共通	15,000億円	3/25 ~ 7/5 (102日間)	応札	560億円	落札	560億円	0.000%	全取	平均	0.000% (固定)
国債補完	48,287億円	3/23 ~ 3/24 (1日間)	応札	2,238億円	落札	2,238億円	-0.500%	全取	平均	-0.500% (即)
流動性供給	応札 1兆9,567億円	落札	4,996億円	3/25 募入最大利回較差	▲0.008%	按分	92.2330%	募入平均利回較差	▲0.016%	

「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