

**<<資金需給>>**

単位 億円

	1日需給速報		2日需給予想	3日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,700	1,000	1,000
財政		▲ 7,100	4,600	▲ 20,000
資金過不足		▲ 5,400	5,600	▲ 19,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,600	10,400
141,500			▲ 3,200	▲ 13,500
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		10,000		
国庫短期証売却				
国債買入		6,800		
CP等買入				
		▲ 300		
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				
国債補充供給				
小計		16,500	▲ 1,600	▲ 3,100
当増減		11,100	4,000	▲ 22,100

当座預金残高	1,297,800	4/1以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,178,500		34,200
積み終了先	990,100	4/2以降の残り所要積立額	
超過準備	989,500	積数	29,200
非準備先残高	119,300	1日平均	2,100
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)			1,872,100
準備預金進捗率	98.44% (実績)		54.84% (日数)

<b>3/31のマネタリーベース</b>		<b>2,198,900</b>	
3/31コール	合計	159,463 無担	51,390 有担
108,073			
コール前日増減	計	▲ 4,796 無担	▲ 4,512 有担
			▲ 284

4/1の加重平均レート(速報)			3/31の加重平均レート(確報)			単位(%)
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-I	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.050 ~0.145 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.010 ~0.085 (0.044)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.040 ~0.121 (0.057)				T/N	0.040 ~0.123 (0.052)	
				S/N	0.020 (0.020)	
0.110 ~0.200 (0.134)				1W	0.260 (0.260)	
0.118 ~0.295 (0.191)				2W	0.295 (0.295)	
				3W		
0.118 ~0.290 (0.175)		0.08-0.13	0.0200	1M		有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M		
		0.08-0.13	0.025-0.035	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通 15,000億円 4/3 ~ 8/1 (120日間) 応札 10,430億円 落札 10,430億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 米ドル資金供給(固定金利方式) 4/3~4/10 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.580%  
 米ドル資金供給(固定金利方式) 4/3~6/26 (84日間) 応札なし 貸付利率 0.580%  
 10年利付国債(表面利率0.6%) 応札10兆3,648億円 落札2兆1,759億円(I非競争入札:2,193億円) 4/3~2024/3/20 0.636% 按分48.9952% 平均0.634%

「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。」

4/2の日銀調節とレート予想				
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,301,800	前日比 4,000
O/N	0.04~0.07	T/N	0.04~0.12	S/N 0.04~0.12

無担O/Nは0.06%前後の出合いが中心となるであろう。

**<< 1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1兆円増の100兆8,000億円(当座預金残高見込は129兆9,000億円)。本日の無担O/Nは、年度末要因が剥落した事でビッドが回復した。地銀・信託・証券業態から0.055~0.065%での調達、大手行からは0.05%での調達希望で始まった。出合い一巡後は、ビッドレートがやや低下し、閑散とした状況のなか本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態からロール案件が数件見られた程度。共通担保資金供給オペは、4M物1兆5,000億円のオファーに対し、1兆430億円の落札となった。なお、4/3の共通担保資金供給オペの期落ち分は13,470億円であった。

**<< 1日のオープン市場動向 >>**  
 現先レートS/Nは、年度末要因で低下していた足元の目線が、需給要因によって切り上がる展開で推移した。短国市場は、品薄感から動意が薄い状態。出合いは、1M:0.02%、3M:0.025~0.035%となっている。CP市場は、期末要因で残高が大幅に減少した銘柄ではレートが低下したものの、大部分が同水準での発行となった。発行総額は2,200億円程度となっている。

- << 2日の材料 >>**
- \*3月のマネタリーベース
  - \*4月の日銀当座預金増減要因見込み
  - \*米国2月の製造業新規受注・出荷・在庫
  - \*ユーロ圏10-12月期のGDP確報値
  - \*交付税特別会計借入(10,500億円、4/11発行)

<<コール3月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07194%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07210%	有担 0.04100%

<b>JGB新発10年債</b>	<b>日経平均株価(終値)</b>	<b>為替(9時)</b>	<b>103.21-23</b>
0.615 ▲ 0.025	14,791.99 ▲ 35.84	為替(5時)	103.31-32

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	3/25	3/26	3/27	3/28	3/31	4/1
日銀当預残	1,244,900	1,276,000	1,271,700	1,282,000	1,286,700	1,297,800
準備預金残	1,127,600	1,161,900	1,162,900	1,172,000	1,195,000	1,178,500
レート	0.069%	0.070%	0.070%	0.069%	0.044%	0.065%
月中平均	0.07356%	0.07342%	0.07330%	0.07287%	0.07194%	0.06500%

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