

<<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,500	1,100	1,000
財政		4,800	▲ 22,700	5,000
資金過不足		6,300	▲ 21,600	6,000
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	2,100
139,930		▲ 3,200	▲ 13,500	▲ 3,300
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証券入				
国庫短期証券却				
国債買入				9,000
CP等買入			▲ 100	
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				
国債補完供給				
小計		▲ 1,600	▲ 3,200	7,800
当預増減		4,700	▲ 24,800	13,800

当座預金残高	1,302,500	4/2以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,190,100		29,200
積み終了先	1,001,900	4/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,001,900	積数	23,900
非準預先残高	112,400	1日平均	1,800
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	98.72% (実績)	58.06% (日数)	

4/1のマネタリーベース		2,208,200	
4/1コール	合計	156,978	無担 48,878 有担 108,100
コール前日増減	計	▲ 2,485	無担 ▲ 2,512 有担 27

4/2の加重平均レート(速報)			4/1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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.050 ~0.145 (0.064)	0.040 ~0.050 (0.041)		0.050 ~0.145 (0.065)	0.040 ~0.121 (0.059)	0.040 ~0.050 (0.041)	
0.065 ~0.121 (0.093)						
0.116 ~0.117 (0.117)			1W 0.170 (0.170)	0.110 ~0.200 (0.128)		
0.330 (0.330)			2W	0.118 ~0.295 (0.191)		
0.293 (0.293)			3W			
0.075 ~0.120 (0.094)		0.08-0.13	1M 0.270 (0.270)	0.118 ~0.290 (0.161)	有担先日付分	
		0.08-0.13	2M	0.195 (0.195)		
0.118 (0.118)		0.08-0.13	3M	0.125 (0.125)		
		-	6M			
		-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	4/4	~ 7/7 (94日間)	応札	2,100億円	落札	2,100億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債買入	2,500億円	4/4		応札	9,912億円	落札	2,500億円	按分利回り較差	0.004%	95.6%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	2,500億円	4/4		応札	13,268億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	0.007%	68.3%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	4,000億円	4/4		応札	9,371億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.010%	54.3%	平均利回り較差	0.012%

交付税特会 1兆500億円 4/11~10/10 応札 2兆8,600億円 落札 1兆500億円 0.100% 按分 21.7395% 平均 0.096%

4/3の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,277,700	前日比	▲ 24,800
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。

<< 2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5,000億円減の100兆3,000億円(当座預金残高見込は130兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.06%前後、大手行からは0.055%近辺での調達希望で始まった。一巡後は、0.055%の出合いも複数散見され、本日の取引を終えた。ターム物は、昨日と同様に、証券業態からのロール案件が見られた程度。

<< 2日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、横ばい圏での推移。短国市場は、新年度最初となる3日の入札を控えて様子見の参加者が大勢であった。アウトライト市場は、1M:0.0275~0.03%、3M:0.03%、1Y:0.03%での出合い。CP市場は、電機・ノンバンク業態からまとまった金額の発行が実施されたことで、発行総額1,600億円程度となった。市場参加者の購入ニーズが比較的強く、発行レートが低下した銘柄が多く見られた。

<< 3日の材料 >>
 *ECB定例理事会(金融政策発表あり)
 *米国2月の貿易収支
 *米国3月のISM非製造業景況指数
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、4/7発行)
 *10年物価連動国債入札(4,000億円、4/10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%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.625	0.010	14,946.32	154.33	103.63-65	
				為替(5時) 103.80-81	

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	3/26	3/27	3/28	3/31	4/1	4/2
日銀当預残	1,276,000	1,271,700	1,282,000	1,286,700	1,297,800	1,302,500
準備預金残	1,161,900	1,162,900	1,172,000	1,195,000	1,178,500	1,190,100
レート	0.070%	0.070%	0.069%	0.044%	0.065%	0.064%
月中平均	0.07342%	0.07330%	0.07287%	0.07194%	0.06500%	0.06450%

「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