

<<資金需給>>

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想		10日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,500	1,000	▲ 1,000		
財政		3,800	▲ 2,400	▲ 10,000		
資金過不足		5,300	▲ 1,400	▲ 11,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			2,200	12,700		
132.870			▲ 2,100	▲ 15,100		
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		6,200	6,000			
CP等買入				4,400		
			▲ 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						
国債補完供給						
小計		21,200	5,800	2,000		
当預増減		26,500	4,400	▲ 9,000		

4/9の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,305,500	前日比	4,400
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.065%前後の出合いが中心となるであろう。

<< 8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2兆7,000億円増の101兆4,000億円(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・信託業態から0.065%前後での調達、大手行からは0.055%付近での調達希望と、昨日同様の展開で始まった。高水準の当座預金残高を背景に、一巡後は散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が見られた程度。共通担保資金供給オペは、3M物2兆円のオフアーに対し、1兆2,680億円の落札となった。なお、4月10日の期落ち分は1兆5,078億円であった。

<< 8日のオープン市場動向 >>

現先取引S/Nは前日比ほぼ横ばいでの動き。短国市場は特段の材料無く、6Mで0.035%が散発的に見られた程度で、動意の乏しい地合いであった。CP発行市場は10日発行ではあるものの、発行総額は1,000億円程度に止まった。旺盛な購入意欲から発行レートの銘柄間格差は縮小傾向となった。

<< 9日の材料 >>

- *日銀金融経済月報
- *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
- *米国2月の卸売売上高
- *流動性供給入札(3,000億円、4/11発行)

当座預金残高	1,301,100	4/8以降の残り所要積立額	11,500
準備預金残高	1,184,400	4/9以降の残り所要積立額	8,900
積み終了先	1,009,400	積数	1,300
超過準備	1,009,400	1日平均	1,300
非準備先残高	116,700		
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,884,300		
準備預金進捗率	99.53% (実績)	77.42% (日数)	

JGB新発10年債	0.620	0.010	日経平均株価(終値)	14,606.88	▲ 201.97	為替(9時)	103.05-07
						為替(5時)	102.79-80

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	4/1	4/2	4/3	4/4	4/7	4/8
日銀当預残	1,297,800	1,302,500	1,277,800	1,289,300	1,274,600	1,301,100
準備預金残	1,178,500	1,190,100	1,164,100	1,172,400	1,163,100	1,184,400
レート	0.065%	0.064%	0.064%	0.066%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06500%	0.06450%	0.06433%	0.06517%	0.06514%	0.06513%

4/7のマナターベース			2,179,200			
4/7コール	合計	144,565	無担	44,405	有担	100,160
コール前日増減	計	▲ 2,260	無担	▲ 389	有担	▲ 1,871

4/8の加重平均レート(速報)				4/7の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分	
0.030 ~0.145 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)	CP気配a-1	短国	O/N	0.055 ~0.145 (0.065)			0.040 ~0.050 (0.041)	
0.065 ~0.120 (0.076)				T/N		0.060 ~0.120 (0.073)			
				S/N					
0.120 ~0.170 (0.145)				1W		0.260 ~0.290 (0.270)			
0.140 ~0.330 (0.224)				2W		0.180 (0.180)			
0.143 (0.143)				3W		0.220 ~0.420 (0.353)			
		0.08-0.13	0.035-0.038	1M		0.145 ~0.260 (0.174)		有担先日付分	
		0.08-0.13	0.0390	2M					
		0.08-0.13	-	3M					
		-	0.0350	6M					
		-	0.0330	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 20,000億円 4/10 ~ 7/23 (104日間) 応札 12,680億円 落札 12,680億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)

米ドル資金供給(固定金利方式) 4/10~4/17 (7日間) 応札 億ドル 落札 億ドル 貸付利率 0.580%

ETF買入 116億円 約定日 4/8

J-REIT買入 3億円 約定日 4/8

<<日銀金融政策決定会合・結果>>

- ・マナターベースが、年間約60~70兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(全員一致)
- ・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。
- ①長期国債について、保有残高が年間約50兆円に相当するペースで増加し、平均残存期間が7年程度となるよう買入れを行う。
- ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約1兆円、年間約300億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。

「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。