

**<<資金需給>>**

単位 億円

|             | 9日需給速報 |        | 10日需給予想 | 11日当社予想 |
|-------------|--------|--------|---------|---------|
|             | 即日     | 金額     | 金額      | 金額      |
| 銀行券         |        | 900    | 300     | ▲1,000  |
| 財政          |        | ▲1,900 | ▲5,100  | ▲1,000  |
| 資金過不足       |        | ▲1,000 | ▲4,800  | ▲2,000  |
| 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  |         |
| 132,939     |        | ▲2,100 | ▲15,100 |         |
| 国債買現        |        |        |         |         |
| 0           |        |        |         |         |
| CP買現        |        |        |         |         |
| 0           |        |        |         |         |
| 国庫短期証買入     |        |        |         |         |
| 国庫短期証売却     |        |        |         |         |
| 国債買入        |        | 6,000  |         |         |
| CP等買入       |        | ▲300   | 4,400   | ▲500    |
| 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          |        | 5,800  | 1,500   | 0       |
| 当預増減        |        | 4,800  | ▲3,300  | ▲2,000  |

|         |             |                           |             |
|---------|-------------|---------------------------|-------------|
| 当座預金残高  | 1,305,900   | 4/9以降の残り所要積立額             | 8,900       |
| 準備預金残高  | 1,188,900   | 4/10以降の残り所要積立額            |             |
| 積み終了先   | 1,015,400   | 積数                        | 6,500       |
| 超過準備    | 1,014,900   | 1日平均                      | 1,100       |
| 非準備先残高  | 117,000     | 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 | 99.66% (実績) |                           | 80.65% (日数) |

|             |    |           |                      |
|-------------|----|-----------|----------------------|
| 4/8のマナターベース |    | 2,204,200 |                      |
| 4/8コール      | 合計 | 145,201   | 無担 44,867 有担 100,334 |
| コール前日増減     | 計  | 636       | 無担 462 有担 174        |

| 4/9の加重平均レート(速報)      |       |                |             | 4/8の加重平均レート(確報)      |                      |                      |        |
|----------------------|-------|----------------|-------------|----------------------|----------------------|----------------------|--------|
| 無担(平均)               |       | 有担(平均)         |             | 無担当日分                |                      | 無担先日付分               |        |
| 0.035 ~0.145 (0.064) | 0.040 | ~0.050 (0.041) |             | 0.030 ~0.145 (0.065) |                      | 0.065 ~0.120 (0.076) |        |
| 0.065 ~0.120 (0.097) |       |                |             |                      |                      |                      |        |
| 0.065 ~0.200 (0.119) |       |                |             | 0.170 (0.170)        | 0.120 ~0.150 (0.140) |                      |        |
|                      |       |                |             | 1W                   | 0.140 ~0.330 (0.224) |                      |        |
|                      |       |                |             | 2W                   | 0.143 (0.143)        |                      |        |
|                      |       |                |             | 3W                   |                      |                      |        |
|                      |       | 0.08-0.13      | 0.0400      | 1M                   |                      |                      | 有担先日付分 |
|                      |       | 0.08-0.13      | -           | 2M                   |                      |                      |        |
|                      |       | 0.08-0.13      | 0.0500      | 3M                   |                      |                      |        |
|                      |       | -              | 0.034-0.035 | 6M                   |                      |                      |        |
|                      |       | -              | -           | 1Y                   |                      |                      |        |

**<<オペ情報、入札結果>>**

流動性供給 応札 7,781億円 落札 2,987億円 4/11 募入最大利回較差 0.000% 按分 7.9510% 募入平均利回較差 ▲0.005%  
 ETF買入 116億円 約定日 4/9  
 J-REIT買入 3億円 約定日 4/9

「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

| << 4/10の日銀調節とレート予想 >> |           |        |           |     |           |
|-----------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節                  | 見送り       | 当座預金残高 | 1,302,600 | 前日比 | ▲3,300    |
| 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。

**<< 9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1,000億円増の101兆5,000億円(当座預金残高見込は130兆6,000億円)。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%付近での調達希望で始まった。連日、相似した展開が続いており、午後からは昨日同様に閑散とした状況となり、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。

**<< 9日のオープン市場動向 >>**

現先取引S/Nはほぼ横ばい水準で推移。短国市場は残存3M物0.05%の出合いが中心。6M物では0.034~0.035%の取引が見られた。CP市場は石油・鉄鋼・電機業態から発行が見られ、総額1,200億円ほどの発行。レート水準に概ね変化はないが、4月期内物ではやや高めの決着が目立った。

**<< 10日の材料 >>**

- \*2月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲3.0%)
- \*宮尾日銀審議委員岡山県金融経済懇談会にて講演
- \*MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
- \*米国3月の財政収支
- \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、4/14発行)

|           |       |        |            |           |         |        |           |
|-----------|-------|--------|------------|-----------|---------|--------|-----------|
| JGB新発10年債 | 0.615 | ▲0.005 | 日経平均株価(終値) | 14,299.69 | ▲307.19 | 為替(9時) | 101.95-96 |
|           |       |        |            |           |         | 為替(5時) | 101.98-99 |

| 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                             | 4/2       | 4/3       | 4/4       | 4/7       | 4/8       | 4/9       |
| 日銀当預残                          | 1,302,500 | 1,277,800 | 1,289,300 | 1,274,600 | 1,301,100 | 1,305,900 |
| 準備預金残                          | 1,190,100 | 1,164,100 | 1,172,400 | 1,163,100 | 1,184,400 | 1,188,900 |
| レート                            | 0.064%    | 0.064%    | 0.066%    | 0.065%    | 0.065%    | 0.064%    |
| 月中平均                           | 0.06450%  | 0.06433%  | 0.06517%  | 0.06514%  | 0.06513%  | 0.06500%  |