

**<<資金需給>>**

単位 億円

	11日需給速報		14日需給予想	15日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	900	1,000
財政		1,600	▲ 11,000	20,000
資金過不足		1,500	▲ 10,100	21,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			3,600	11,800
130,541			▲ 3,000	▲ 15,000
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			9,100	
CP等買入				
		▲ 300	▲ 200	
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		100	100	
国債補完供給				
小計		▲ 200	9,600	▲ 3,200
当増減		1,300	▲ 500	17,800

当座預金残高	1,301,500	4/11以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,183,000		4,700
積み終了先	1,013,900	4/14以降の残り所要積立額	
超過準備	1,013,800	積数	1,500
非準備先残高	118,500	1日平均	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	99.92%	(実績)	93.55% (日数)

4/10のマネタリーベース		2,202,100	
4/10コール	合計	143,857	無担 43,471 有担 100,386
コール前日増減	計	740	無担 ▲ 1,195 有担 1,935

4/11の加重平均レート(速報)			4/10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 ~ 0.085 (0.065)	0.040 ~ 0.050 (0.041)		0.030 ~ 0.145 (0.065)		0.040 ~ 0.050 (0.041)	
0.065 ~ 0.125 (0.108)				0.065 ~ 0.120 (0.077)		
0.130 ~ 0.400 (0.218)				0.170 ~ 0.290 (0.250)		
0.116 ~ 0.293 (0.162)		0.08-0.13		0.145 ~ 0.350 (0.230)	有担先日付分	
		0.08-0.13	0.0525-0.0550			
0.120 (0.120)		0.08-0.13	0.0490-0.0500			
		-	-			
		-	-			
		-	-			

4/14の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,301,000	前日比	▲ 500
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。

<< 11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5,000億円増の101兆7,000億円(当座預金残高見込は130兆1,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態で0.06~0.065%での調達、大手行からは0.055%前後での調達希望で始まった。調達ニーズは限定的で、出合い一巡後は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。

<< 11日のオープン市場動向 >>  
 現先取引S/Nは横ばいからやや上昇で推移。短国市場は2M物の入札が実施された。W I取引で0.0525~0.055%の出合いが見られるなか、落札結果は平均利回0.0540%、按分利回0.0547%と足元金利の上昇を反映した結果となった。CP市場は15日発行となり、鉄鋼・電機業態などからまとまった額の案件が見られたことで、発行総額は2,400億円程度。レート水準は概ね横ばいでの決着であった。

<< 14日の材料 >>  
 \*2月のマネタリーサーベイ  
 \*米国2月の企業在庫  
 \*米国3月の小売売上高

JGB新発10年債	0.605	0.000	日経平均株価(終値)	13,960.05	▲ 340.07	為替(9時)	101.38-40
						為替(5時)	101.73-74

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	4/4	4/7	4/8	4/9	4/10	4/11
日銀当預残	1,289,300	1,274,600	1,301,100	1,305,900	1,300,200	1,301,500
準備預金残	1,172,400	1,163,100	1,184,400	1,188,900	1,183,300	1,183,000
レート	0.066%	0.065%	0.065%	0.064%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06517%	0.06514%	0.06513%	0.06500%	0.06500%	0.06500%

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通 20,000億円 4/15 ~ 7/25 (101日間) 応札 11,820億円 落札 11,820億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 社債買入 1,000億円 4/17 応札 1,892億円 落札 929億円 按分レート 0.103% 98.6% 平均落札レート 0.113%  
 T-Bill2M 応札 16兆2,029億円 落札 2兆3,274億8,000万円(非競争入札:1,725億円) 4/15~6/4 0.0547% 按分49.4009% 平均0.0540%  
 30年利付国債(表面利率1.7%) 応札 1兆8,684億円 落札 6,368億円(I 非競争入札:623億円) 4/15~2044/3/20 1.700% 按分45.7608% 平均 1.696%  
 ETF買入 116億円 約定日 4/11

「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