

**《資金需給》**

単位 億円

	31日需給速報		1日需給予想	2日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,300	400	1,000
財政		14,300	▲ 4,000	15,000
資金過不足		15,600	▲ 3,600	16,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
67,517				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		7,500		
国庫短期証売却				
国債買入		10,700	4,200	
CP等買入		6,000		
		▲ 8,000	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470				
被災地支援				
3,252				
社債等買入				
ETF買入		300	300	
国債補充供給	即日	▲ 500	500	
小計		16,000	4,900	0
当増減		31,600	1,300	16,000

当座預金残高	2,015,600	3/31以降の残り所要積立額	17,300
準備預金残高	1,865,200	4/1以降の残り所要積立額	13,300
積み終了先	1,539,200	積数	900
超過準備	1,539,100	1日平均	1,974,600
非準備先残高	150,400		
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)			
準備預金進捗率	99.33% (実績)	51.61% (日数)	

3/30のマナターベース		2,928,300	
3/30コール	合計	188,603	無担 63,225 有担 125,378
コール前日増減	計	▲ 5,196	無担 ▲ 2,441 有担 ▲ 2,755

3/31の加重平均レート(速報)			3/30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	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.001 ~ 0.075 (0.015)	0.030 ~ 0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~ 0.130 (0.064)		0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.060 ~ 0.123 (0.084)				T/N	0.001 ~ 0.125 (0.016)	
				S/N		
0.117 ~ 0.260 (0.153)				1W	0.125 ~ 0.220 (0.149)	
0.160 ~ 0.185 (0.173)				2W	0.118 ~ 0.185 (0.131)	
0.118 ~ 0.185 (0.152)				3W		
0.100 ~ 0.185 (0.152)		0.08-0.13	-	1M	0.145 (0.145)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	0.005-0.006	3M		
		-	▲ 0.015	6M		
		-	▲ 0.015-▲ 0.010	1Y		

**《オペ情報、入札結果》**

国債補完 19,261億円 3/31 ~ 4/1 (1日間) 応札 462億円 落札 462億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)  
米ドル資金供給(固定金利方式) 4/2~4/9 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.620%

4/1の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,016,900	前日比	1,300
O/N	0.055~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.06%前後の出合いが中心になると見込まれる。

**《 31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みは、前日比4兆3,000億円増の155兆円(当座預金残高見込みは初の200兆円台となる201兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.01%未満での調達で始まった。一巡後も、引続き0.01%未満を中心に散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件も含め、ほとんど出合いは見られなかった。

**《 31日のオープン市場動向 》**

現先レートS/Nは、概ね昨日と同水準であった。短国市場は、期末日であったため取引閑散。3M:0.005~0.006%、6M:▲0.015%、1Y:▲0.015~▲0.01%での出合いが少々見られた程度であった。CP市場は、石油業態からまとまった金額の発行が実施され、発行総額は1,500億円程度となった。発行レートは、一部の銘柄で小高く推移しているものの、全体的には低位となっていた。

**《 1日の材料 》**

- \*3月調査の日銀短観(概要及び要旨)
- 市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI):+14
- \*3月実績/4月見込み財政資金対民間収支
- \*米国2月の建設支出 \*米国3月のISM製造業景況指数

《コール3月の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	0.07010%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06968%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	120.03-05
0.395 0.025	19,206.99 ▲ 204.41	為替(5時)	120.20-22

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	3/24	3/25	3/26	3/27	3/30	3/31
日銀当預残	1,938,400	1,968,700	1,969,300	1,974,800	1,984,000	2,015,600
準備預金残	1,781,600	1,809,400	1,814,100	1,828,900	1,827,400	1,865,200
レート	0.064%	0.065%	0.065%	0.067%	0.064%	0.015%
月中平均	0.07346%	0.07312%	0.07281%	0.07221%	0.07193%	0.07010%

「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

**今期もありがとうございました。来期もよろしくお願ひ申し上げます。**