

<<資金需給>>

単位 億円

	1日需給速報	2日需給予想	3日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	500	300	1,000
財政	▲ 4,000	▲ 6,100	5,000
資金過不足	▲ 3,500	▲ 5,800	6,000
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			
国庫短期証売却			
国債買入	4,200		11,300
CP等買入	▲ 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		
国債補充供給	500		
小計	4,900	0	11,300
当預増減	1,400	▲ 5,800	17,300

当座預金残高	2,017,000	4/1以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,849,900		13,300
積み終了先	1,525,000	4/2以降の残り所要積立額	
超過準備	1,525,000	積数	9,900
非準備先残高	167,100	1日平均	700
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,974,600		
準備預金進捗率	99.50% (実績)	54.84% (日数)	

3/31のマネタリーベース		2,958,600	
3/31コール	合計	192,626 無担	59,128 有担
コール前日増減	計	4,023 無担	▲ 4,097 有担

4/1の加重平均レート(速報)				3/31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		有担当日分	
0.010 ~0.130 (0.056)	0.030	~0.040 (0.031)					O/N	0.001 ~0.075 (0.015)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.045 ~0.120 (0.059)					T/N		0.060 ~0.123 (0.084)		
0.090 (0.090)					S/N				
0.065 ~0.155 (0.113)					1W		0.117 ~0.260 (0.153)		
0.118 (0.118)					2W		0.160 ~0.185 (0.173)		
					3W		0.118 ~0.185 (0.152)		
0.170 ~0.630 (0.212)		0.08-0.13	-	1M			0.100 ~0.185 (0.152)		有担先日付分
0.119 ~0.130 (0.123)		0.08-0.12	-	2M					
0.117 ~0.118 (0.117)		0.08-0.12	0.005	3M					
		-	▲0.015	6M					
		-	▲0.015	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	3,750億円	4/3	応札	7,437億円	落札	3,754億円	按分利回り較差	-0.008%	93.4%	平均利回り較差	-0.006%
国債買入	3,750億円	4/3	応札	6,952億円	落札	3,755億円	按分利回り較差	-0.009%	42.4%	平均利回り較差	-0.007%
国債買入	2,400億円	4/3	応札	5,577億円	落札	2,403億円	按分利回り較差	0.007%	98.7%	平均利回り較差	0.010%
国債買入	1,400億円	4/3	応札	4,489億円	落札	1,407億円	按分利回り較差	0.021%	48.0%	平均利回り較差	0.025%
ETF買入	352億円	約定日	4/1								
J-REIT買入	12億円	約定日	4/1								

「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り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

<< 4/2の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,011,200	前日比	▲ 5,800
O/N	0.05~0.06	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.05~0.06%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 1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1兆6,000億円減少の153兆4,000億円(当座預金残高見込みは過去最高の201兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.05~0.055%、大手行から0.05%程度での調達で始まった。年度末要因が剥落したものの、先週のレート水準まで戻すには至らず、一巡後も0.05~0.055%前後を中心に散発的に出合う程度で本日の取引を終了した。ターム物については、証券業態の出合いが中心となっていた。

<< 1日のオープン市場動向 >>
現先レートS/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、3M:0.005%、6M:▲0.015%、1Y:▲0.015%で出合ったものの、全体的には取引閑散であった。CP市場は、鉄鋼・石油業態からまとまった発行が実施され、発行総額は1,300億円程度となった。発行レートは、概ね昨日と同水準であった。

<< 2日の材料 >>
*3月のマネタリーベース
*4月の日銀当座預金増減要因見込み
*米国2月の貿易収支 *米国2月の製造業新規受注・出荷・在庫
*国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、4/6発行)
*10年利付国債入札(24,000億円、4/6発行)

<<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	0.375	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	19,034.84	▲ 172.15	為替(9時)	119.96-99
						為替(5時)	119.89-90

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	3/25	3/26	3/27	3/30	3/31	4/1
日銀当預残	1,968,700	1,969,300	1,974,800	1,984,000	2,015,600	2,017,000
準備預金残	1,809,400	1,814,100	1,828,900	1,827,400	1,865,200	1,849,900
レート	0.065%	0.065%	0.067%	0.064%	0.015%	0.056%
月中平均	0.07312%	0.07281%	0.07221%	0.07193%	0.07010%	0.05600%