

<<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	6日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		300	100	2,000
財政		▲ 5,700	5,700	▲ 26,000
資金過不足		▲ 5,400	5,800	▲ 24,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,300
67,517				▲ 2,400
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			11,600	
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				
国債補完供給				
小計		0	11,500	▲ 100
当預増減		▲ 5,400	17,300	▲ 24,100

当座預金残高	2,011,600	4/2以降の残り所要積立額	9,900
準備預金残高	1,846,100		
積み終了先	1,522,600	4/3以降の残り所要積立額	6,700
超過準備	1,522,600	積数	6,700
非準備先残高	165,500	1日平均	500
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	99.66% (実績)	58.06% (日数)	

4/1のマナターベース		2,959,500	
4/1コール	合計	180,412	無担 56,076 有担 124,336
コール前日増減	計	▲ 12,214	無担 ▲ 3,052 有担 ▲ 9,162

4/2の加重平均レート(速報)			4/1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
0.010 ~0.130 (0.057)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.010 ~0.130 (0.056)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.050 ~0.120 (0.058)				T/N	0.045 ~0.120 (0.059)	
				S/N	0.090 (0.090)	
0.060 ~0.117 (0.065)				1W 0.155 (0.155)	0.065 (0.065)	
0.118 (0.118)				2W	0.118 (0.118)	
0.118 (0.118)				3W		
		0.08-0.13	-	1M 0.260 (0.260)	0.170 ~0.630 (0.203)	有担先日付分
0.110 (0.110)		0.08-0.12	-	2M	0.119 ~0.130 (0.123)	
		0.08-0.12	0.002-0.005	3M	0.117 ~0.630 (0.151)	
		-	-	6M		
		-	▲0.019-▲0.005	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	4/6 ~ 7/6 (91日間)	応札	2,251億円	落札	2,251億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	2,070億円	4/2 ~ 4/3 (1日間)	応札	1億円	落札	1億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
T-Bill3M	応札14兆8,369億5,000万円	落札4兆9,690億5,000万円(非競争入札:4,109億円)	4/6~7/6	0.0160%	按分	18.4277%	平均	0.0092%		
10年利付国債(表面利率0.4%)	応札6兆36億円	落札2兆1,858億円(I非競争入札:2,104億円)	4/6~2025/3/20	0.373%	按分	32.3576%	平均	0.369%		
J-REIT買入	12億円	約定日	4/2							

4/3の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,028,900	前日比	17,300
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。

<< 2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9,000億円減少の152兆5,000億円(当座預金残高見込みは201兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.051~0.055%、大手行から0.05%程度での調達が始まった。税揚げ日ではあったものの、交付税交付金の払いもあつてか取り急ぐ動きはみられず、一日を通して昨日と同水準の0.05~0.055%前後を中心に推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関しては、大手行から2、3W物0.118%で調達が行われ、まとまった出合いがみられた。3M物の共通担保オペが8,000億円オフアールされ、落札総額2,251億円(期落ち分2,400億円)で札割れとなった。

<< 2日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは、昨日と同水準で推移した。短国市場は、新発3M物の入札が実施された。発行予定の減額や入札方式に若干の変更が行われたことで注目が集まる中、平均落札利回り0.0092%、最高落札利回り0.016%と事前予想より若干低い結果となった。入札後にショートカバーが散見され、3M:0.002~0.005%、1Y:▲0.019~▲0.005%での出合いがみられた。CP市場は、鉄鋼や石油業態からまとまった発行が実施され、発行総額は1,200億円程度となった。発行レートは概ね横ばい。

<< 3日の材料 >>

- *米国3月の雇用統計
- *米国休場、欧州・英国祝日 (Good Friday)

《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	0.335	▲ 0.040	日経平均株価(終値)	19,312.79	277.95	為替(9時)	119.58-59
						為替(5時)	119.52-54

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	3/26	3/27	3/30	3/31	4/1	4/2
日銀当預残	1,969,300	1,974,800	1,984,000	2,015,600	2,017,000	2,011,600
準備預金残	1,814,100	1,828,900	1,827,400	1,865,200	1,849,900	1,846,100
レート	0.065%	0.067%	0.064%	0.015%	0.056%	0.057%
月中平均	0.07281%	0.07221%	0.07193%	0.07010%	0.05600%	0.05650%

「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す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