

**<<資金需給>>**

単位 億円

	3日需給速報		6日需給予想	7日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	2,000	1,000
財政		5,700	▲ 28,900	▲ 1,000
資金過不足		5,900	▲ 26,900	0
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				20,000
国庫短期証売却				
国債買入		11,600		11,500
CP等買入				
		▲ 100	▲ 400	
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		11,500	▲ 500	31,500
当増増減		17,400	▲ 27,400	31,500

当座預金残高	2,029,000	4/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,860,800		6,700
積み終了先	1,538,900	4/6以降の残り所要積立額	
超過準備	1,537,600	積数	600
非準備先残高	168,200	1日平均	100
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	99.97%	(実績)	67.74% (日数)

4/2のマナリーベース				2,953,900
4/2コール	合計	185,189	無担	60,360
			有担	124,829
コール前日増減	計	4,777	無担	4,284
			有担	493

4/3の加重平均レート(速報)				4/2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
0.045 ~0.130 (0.058)	0.030	~0.040 (0.031)				0.010 ~0.130 (0.057)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.050 ~0.120 (0.063)							0.050 ~0.120 (0.058)	
0.055 ~0.200 (0.100)							0.060 ~0.117 (0.065)	
0.310 (0.310)							0.118 (0.118)	
							0.118 (0.118)	
				0.08-0.13	-		0.140 (0.140)	有担先日付分
				0.08-0.12	-		0.110 ~0.120 (0.112)	
				0.08-0.12	0.002-0.003			
				-	-			
				-	-			
				-	-			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	1,551億円	4/3	~ 4/6 (3日間)	応札	3億円	落札	3億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	20,000億円	4/7		応札	29,611億円	落札	20,002億円	按分利回り較差	0.002%	30.5%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	3,750億円	4/7		応札	7,854億円	落札	3,756億円	按分利回り較差	-0.013%	22.0%	平均利回り較差	-0.008%
国債買入	3,750億円	4/7		応札	8,876億円	落札	3,753億円	按分利回り較差	0.001%	12.0%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	4/7		応札	11,175億円	落札	4,001億円	按分利回り較差	0.016%	3.5%	平均利回り較差	0.019%

「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

<< 4/6の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,001,600	前日比	▲ 27,400
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。

<< 3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1兆9,000億円増加の154兆4,000億円(当座預金残高見込みは202兆9,000億円)。無担O/Nは朝方、地銀・信託業態から0.051~0.055%、大手行から0.05%程度での調達が見られた。一巡後は0.05%近辺での出合いで推移し、本日の取引を終了した。ターム物の出合いは閑散であった。

<< 3日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは、引き続き横ばい圏で推移した。短国市場は、短国買入オペが20,000億円オファーされ、按分落札利回り較差+0.002%、平均落札利回り較差+0.004%、按分率30.5%という結果になった。引け値の強い1年物の応札が中心であると見られる。アウトライトは、3M:0.002~0.003%での出合いが見られた。CP市場は、ノンバンク・鉄鋼業態からまとまった発行が実施され、発行総額は1,000億円程度となった。発行レートは概ね横ばいの推移。

<< 6日の材料 >>  
 \*2月の景気動向指数速報  
 \*米国3月のISM非製造業景況指数  
 \*米国3月のFRB労働市場情勢指数  
 \*欧州・英国祝日(Easter Monday)

<<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	0.355	0.020	日経平均株価(終値)	19,435.08	122.29	為替(9時)	119.70-71
						為替(5時)	119.63-64

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	3/27	3/30	3/31	4/1	4/2	4/3
日銀当預残	1,974,800	1,984,000	2,015,600	2,017,000	2,011,600	2,029,000
準備預金残	1,828,900	1,827,400	1,865,200	1,849,900	1,846,500	1,860,800
レート	0.067%	0.064%	0.015%	0.056%	0.057%	0.058%
月中平均	0.07221%	0.07193%	0.07010%	0.05600%	0.05650%	0.05740%

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