

<<資金需給>>

単位 億円

	6日需給速報		7日需給予想	8日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		2,000	1,400	1,000
財政		▲ 29,700	2,500	2,000
資金過不足		▲ 27,700	3,900	3,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,300		
67,368		▲ 2,400		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証券入			20,000	
国庫短期証券売却				
国債買入			11,600	4,500
CP等買入				
		▲ 400	▲ 500	
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	
国債補完供給				
小計		▲ 500	31,400	4,500
当増減		▲ 28,200	35,300	7,500

当座預金残高	2,000,800	4/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,838,400		600
積み終了先	1,516,200	4/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,515,800	積数	200
非準備先残高	162,400	1日平均	0
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	99.99% (実績)	70.97% (日数)	

4/3のマネタリーベース		2,971,000	
4/3コール	合計	195,357	無担 73,513 有担 121,844
コール前日増減	計	10,168	無担 13,153 有担 ▲ 2,985

4/6の加重平均レート(速報)				4/3の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		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)		0.045 ~0.130 (0.058)		0.050 ~0.120 (0.063)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.120 (0.059)								
0.125 ~0.250 (0.146)						0.055 ~0.200 (0.100)		
						0.310 (0.310)		
		0.08-0.13	-				有担先日付分	
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	-					
		-	-					
		-	-					

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	700億円	4/8	応札	2,897億円	落札	702億円	按分利回り較差	-0.003%	24.0%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,400億円	4/8	応札	6,965億円	落札	2,409億円	按分利回り較差	-0.023%	45.9%	平均利回り較差	-0.019%
国債買入	1,400億円	4/8	応札	4,503億円	落札	1,402億円	按分利回り較差	-0.024%	80.0%	平均利回り較差	-0.020%
ETF買入	365億円	約定日	4/6								
J-REIT買入	12億円	約定日	4/6								

「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

<<4/7の日銀調節とレート予想>>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,036,100	前日比	35,300
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。

<<6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2兆9,000億円減少の151兆5,000億円(当座預金残高見込みは200兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは先週末に引き続き、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。ターム物の出合いは閑散であった。

<<6日のオープン市場動向>>
 現先取引S/Nは前営業日に引き続き低位横ばい水準で推移した。短国市場は目立った取引もなく終日閑散であった。CP発行市場は償還額相応で案件は数件にとどまり、発行総額は600億円程度であった。レート水準に特段変化は見られなかった。

<<7日の材料>>
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、8日まで)
 *3月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *米国2月の消費者信用残高
 *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、4/10発行)
 *流動性供給入札(3,000億円、4/9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	0.340	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	19,397.98	▲ 37.10	為替(9時)	118.85-86
						為替(5時)	118.98-00

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	3/30	3/31	4/1	4/2	4/3	4/6
日銀当預残	1,984,000	2,015,600	2,017,000	2,011,600	2,029,000	2,000,800
準備預金残	1,827,400	1,865,200	1,849,900	1,846,500	1,860,800	1,838,400
レート	0.064%	0.015%	0.056%	0.057%	0.058%	0.057%
月中平均	0.07193%	0.07010%	0.05600%	0.05650%	0.05740%	0.05733%

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