

**<<資金需給>>**

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,600	1,000	0
財政		3,700	2,700	▲ 2,000
資金過不足		5,300	3,700	▲ 2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
67,368				
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	4,900	
CP等買入		▲ 500	▲ 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			▲ 100	
ETF買入		300	300	
国債補完供給				
小計		31,400	5,000	0
当預増減		36,700	8,700	▲ 2,000

<< 4/8の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,046,200	前日比	8,700
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。

<< 7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3兆6,000億円増加の155兆1,000億円(当座預金残高見込みは203兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.051~0.053%、大手行から0.05%程度での調達で始まった。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、証券業態によるロール案件中心の取引となった。

<< 7日のオープン市場動向 >>  
 現先取引S/Nは昨日同様、低位で推移した。短国市場は新年度初の6M物の入札が実施され、各利回りは平均▲0.0019%、按分±0%と、やや強めの印象ながら概ね市場予想通りの堅調な結果であった。CP発行市場は件数が少なく、発行総額は1,100億円弱にとどまった。発行レートは概ね横ばいであった。CP等買入オペが4,000億円で開催され、各利回りは平均0.086%、按分0.080%と、6,000億円で開催された前回(0.065%・0.032%)から上昇した。

<< 8日の材料 >>  
 \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)  
 \*黒田日銀総裁、定例会見  
 \*2月の国際収支 \*3月の景気ウォッチャー調査  
 \*MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)

当座預金残高	2,037,500	4/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,870,600		200
積み終了先	1,549,900	4/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,549,900	積数	200
非準備先残高	166,900	1日平均	0
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,984,900		
準備預金進捗率	99.99% (実績)		74.19% (日数)

JGB新発10年債	0.355	0.015	日経平均株価(終値)	19,640.54	242.56	為替(9時)	119.48-50
						為替(5時)	119.82-84

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	3/31	4/1	4/2	4/3	4/6	4/7
日銀当預残	2,015,600	2,017,000	2,011,600	2,029,000	2,000,800	2,037,500
準備預金残	1,865,200	1,849,900	1,846,500	1,860,800	1,838,400	1,870,600
レート	0.015%	0.056%	0.057%	0.058%	0.057%	0.058%
月中平均	0.07010%	0.05600%	0.05650%	0.05740%	0.05733%	0.05743%

4/6のマナターベース				2,940,900		
4/6コール	合計	195,859	無担	73,011	有担	122,848
コール前日増減	計	502	無担	▲ 502	有担	1,004

4/7の加重平均レート(速報)				4/6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 (0.061)								0.050	~0.130 (0.060)
0.063 ~0.260 (0.112)								0.125	~0.250 (0.146)
0.340 (0.340)									
0.080 ~0.185 (0.133)				0.08-0.13	-				有担先日付分
0.145 (0.145)				0.08-0.12	-				
				0.08-0.12	-				
				-	▲0.010-0.000				
				-	-				

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完 4,000億円 4/7 ~ 4/8 (1日間) 応札 7億円 落札 7億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)  
 CP買入 4,000億円 4/10 応札 11,400億円 落札 3,997億円 按分レート 0.080% 85.4% 平均落札レート 0.086%

米ドル資金供給(固定金利方式) 4/9~4/16 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.620%

T-Bill6M 応札14兆9,980億円 落札3兆2,330億5,000万円(非競争入札:2,669億円) 4/10~10/13 0.000% 按分1.2727% 平均▲0.0019%

流動性供給 応札 9,096億円 落札 2,995億円 4/9 募入最大利回較差 0.030% 按分 34.6153% 募入平均利回較差0.022%

「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録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