

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		13日需給予想		14日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		0	1,400	1,000		
財政		▲ 2,300	▲ 20,400	▲ 1,000		
資金過不足		▲ 2,300	▲ 19,000	0		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			1,000			
67,368			▲ 900			
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入					17,500	
国庫短期証売却						
国債買入						11,300
CP等買入		4,000				
		▲ 700	▲ 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		100	200			
国債補完供給						
小計		3,400	200	28,800		
当預増減		1,100	▲ 18,800	28,800		

当座預金残高	2,040,100	4/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,861,800		100
積み終了先	1,541,200	4/13以降の残り所要積立額	
超過準備	1,541,200	積数	0
非準預先残高	178,300	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	100.00% (実績)	90.32% (日数)	

4/9のマネタリーベース				2,976,000
4/9コール	合計	198,579	無担	74,612
			有担	123,967
コール前日増減	計	▲ 2,570	無担	▲ 521
			有担	▲ 2,049

4/10の加重平均レート(速報)				4/9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
0.020 ~0.125 (0.061)	0.030	~0.040 (0.031)		0.045 ~0.130 (0.059)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.051 ~0.120 (0.061)						0.051 ~0.120 (0.063)		
0.053 ~0.200 (0.093)						0.116 (0.116)		
0.180 (0.180)			0.08-0.13			0.180 ~0.200 (0.192)	有担先日付分	
			0.08-0.12					
0.125 (0.125)			0.08-0.12	▲0.002				
				▲0.012		0.145 (0.145)		

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,000億円	4/10	~ 4/13 (3日間)	応札	24億円	落札	24億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	17,500億円	4/14	応札	26,597億円	落札	17,502億円	按分利回り較差	-0.002%	22.2%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	3,750億円	4/14	応札	9,502億円	落札	3,757億円	按分利回り較差	-0.008%	12.6%	平均利回り較差	-0.006%
国債買入	3,750億円	4/14	応札	14,161億円	落札	3,756億円	按分利回り較差	0.001%	1.1%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,400億円	4/14	応札	5,245億円	落札	2,406億円	按分利回り較差	0.007%	53.6%	平均利回り較差	0.011%
国債買入	1,400億円	4/14	応札	4,139億円	落札	1,403億円	按分利回り較差	0.010%	87.5%	平均利回り較差	0.012%

ETF買入 365億円 約定日 4/10

J-REIT買入 12億円 約定日 4/10

<< 4/13の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,021,300	前日比	▲ 18,800
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。

<< 10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1,000億円減少の15兆7,000億円(当座預金残高見込みは204兆円)。無担O/Nは、地銀・信託業態から0.055~0.058%、大手行は0.05~0.055%での調達希望で立ち上がりとなった。週末要因からか昨日よりも強含み、一巡後も0.055~0.056%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、ほとんど出合いが見られなかった。

<< 10日のオープン市場動向 >>
現先取引S/Nは終日低水準で推移した。短国市場は短国買入オペが1兆7,500億円で実施された。2兆円で実施された前回から減額されたものの、各利回り較差は平均±0%、按分▲0.002%と落ち着いた応札姿勢が窺われる結果となった。CP発行市場は案件が数件のみにとどまり、発行総額は700億円弱となった。発行レートは昨日からほぼ横ばいであった。

- << 13日の材料 >>
- *日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)
 - *日銀金融政策決定会合議事要旨(3月16、17日開催分)
 - *2月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲2.8%)
 - *2月の特定サービス産業動態統計速報
 - *3月のマネーストック *3月の企業物価指数
 - *国庫短期証券入札(2ヶ月、25,000億円、4/15発行)

JGB新発10年債	0.340	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	19,907.63	▲ 30.09	為替(9時)	120.54-57
						為替(5時)	120.50-53

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	4/3	4/6	4/7	4/8	4/9	4/10
日銀当預残	2,029,000	2,000,800	2,037,500	2,045,500	2,039,000	2,040,100
準備預金残	1,860,800	1,838,400	1,870,600	1,872,000	1,868,900	1,861,800
レート	0.058%	0.057%	0.058%	0.059%	0.059%	0.061%
月中平均	0.05740%	0.05733%	0.05743%	0.05763%	0.05778%	0.05858%

「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