

<<資金需給>>

単位 億円

	31日需給速報		1日需給予想		2日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,300		1,700		2,000
財政		12,000		▲ 5,700		15,000
資金過不足		13,300		▲ 4,000		17,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		1,000				1,600
141,500		▲ 6,900				▲ 3,200
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入				10,000		
国庫短期証売却						
国債買入				6,800		
CP等買入		4,400		▲ 300		
		▲ 7,400				
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512						
被災地支援						
3,805						
社債等買入						
ETF買入						
国債補完供給		300				
小計		▲ 8,600		16,500		▲ 1,600
当預増減		4,700		12,500		15,400

当座預金残高	1,286,700	3/31以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,195,000		41,300
積み終了先	1,003,000	4/1以降の残り所要積立額	
超過準備	1,000,500	積数	34,200
非準預先残高	91,700	1日平均	2,300
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,872,100		
準備預金進捗率	98.17% (実績)	51.61% (日数)	

3/28のマネタリーベース		2,195,400	
3/28コール	合計	164,259	無担 55,902 有担 108,357
コール前日増減	計	▲ 2,429	無担 ▲ 356 有担 ▲ 2,073

3/31の加重平均レート(速報)			3/28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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.010 ~0.085 (0.044)	0.040 ~0.050 (0.041)		O/N 0.030 ~0.145 (0.069)	0.020 ~0.121 (0.027)	0.040 ~0.050 (0.041)	
0.040 ~0.123 (0.052)			T/N	0.030 (0.030)		
0.020 (0.020)			S/N	0.085 ~0.400 (0.129)		
0.260 (0.260)			1W	0.118 ~0.185 (0.140)		
0.060 ~0.295 (0.107)			2W			
			3W			
		0.08-0.13	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.13	2M			
		0.08-0.13	3M	0.125 (0.125)		
		-	6M			
		-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	4/2 ~ 7/7 (96日間)	応札	1,630億円	落札	1,630億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	2,000億円	3/31 ~ 4/1 (1日間)	応札	4億円	落札	4億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
J-REIT買入	3億円	約定日	3/31							

「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

4/1の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,299,200	前日比	12,500
O/N	0.02~0.075	T/N	0.02~0.12	S/N	0.03~0.12

無担O/Nは0.03~0.05%を中心とした比較的広いレンジでの出合いで推移しよう。

<< 31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は、前日比6,000億円増加の99兆8,000億円(当預金残高見込は128兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.01%、信託・証券業態から0.02~0.05%の調達希望。立ち上がりは0.05%を中心とした出合い。総じて調達需要は弱かったものの、各業態から散発的ながらもビッドが入る場面もあり、一巡後は0.01~0.075%の幅広いレンジの出合いで推移した。T/N、S/N、ターム物は、動意に乏しく閑散な地合いとなった。共通担保資金供給オペは、3M物8,000億円のオファーに対し、応札額1,630億円の札割れとなった。

<< 31日のオープン市場動向 >>
現先レートS/Nは、低位で推移した。短国アウトライトは、店頭での買いから1M:0.02%、2M:0.025%、3M:0.03%の出合いと堅調な地合い。CP市場は、受渡ししが期末跨ぎの約定であったことから、発行総額は400億円程度にとどまった。レートは、期間の長い発行案件が中心だったこともあり、若干低下した。

<< 1日の材料 >>
*消費税率8%に引き上げ
*3月調査の日銀短観
市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+18
*3月実績/4月見込み財政資金対民間収支 *2月の毎月勤労統計調査速報
*米国2月の建設支出 *米国3月のISM製造業景況指数
*10年利付国債入札(24,000億円、4/3発行)

＜コール3月の加重平均レート＞			
(土日を含む)	無担	0.07194%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.07210%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	0.640	0.010	日経平均株価(終値)	14,827.83	131.80	為替(9時)	102.90-91
						為替(5時)	102.97-98

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	3/24	3/25	3/26	3/27	3/28	3/31
日銀当預残	1,217,200	1,244,900	1,276,000	1,271,700	1,282,000	1,286,700
準備預金残	1,106,300	1,127,600	1,161,900	1,162,900	1,172,000	1,195,000
レート	0.073%	0.069%	0.070%	0.070%	0.069%	0.044%
月中平均	0.07375%	0.07356%	0.07342%	0.07330%	0.07287%	0.07194%

今期もありがとうございました。来期もよろしくお願ひ申し上げます。