

<<資金需給>>

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想		7日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		1,200	1,100	2,000		
財政		▲ 22,700	3,500	▲ 11,000		
資金過不足		▲ 21,500	4,600	▲ 9,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		10,400	2,100	15,200		
136,890		▲ 13,500	▲ 3,300	▲ 18,000		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						
国庫短期証売却						
国債買入			9,100			
CP等買入						
		▲ 100	▲ 200			
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						
小計		▲ 3,200	7,700	▲ 2,800		
当預増減		▲ 24,700	12,300	▲ 11,800		

当座預金残高	1,277,800	4/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,164,100		23,900
積み終了先	980,700	4/4以降の残り所要積立額	
超過準備	980,300	積数	20,900
非準備先残高	113,700	1日平均	1,700
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	98.88% (実績)	61.29% (日数)	

4/2のマネタリーベース				2,211,500
4/2コール	合計	159,766	無担	53,782
			有担	105,984
コール前日増減	計	2,788	無担	4,904
			有担	▲ 2,116

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配a-1	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.050 ~0.145 (0.064)	0.040 ~0.050 (0.041)		0.050 ~0.145 (0.064)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.081 ~0.120 (0.101)				0.065 ~0.121 (0.093)		
0.065 (0.065)				0.116 ~0.117 (0.117)		
0.340 (0.340)				0.330 (0.330)		
				0.293 (0.293)		
		0.08-0.13	0.0300	0.075 ~0.120 (0.094)		有担先日付分
		0.08-0.13	-			
		0.08-0.13	0.044-0.051			
		-	-			
		-	-			

4/4の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,290,100	前日比	12,300
O/N	0.04~0.07	T/N	0.04~0.12	S/N	0.04~0.12

無担O/Nは0.06%前後の出合いが中心となるであろう。

<< 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は、前日比1兆8,000億円減の98兆5,000億円(当座預金残高見込みは127兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.06%前後での調達、大手行からは0.055%付近での調達希望と、昨日と同様の展開で始まった。国債発行日ではあったものの、高水準の当座預金残高を背景に、特段取り上がる動きは見られず。取引一巡後は散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いは見られなかった。共通担保資金供給オペは、3M物2兆円のオファーに対し、1兆5,180億円の落札となった。なお、4/7の期落ち分は1兆8,000億円であった。

<< 3日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、概ね同水準の動き。短国市場は、新発3M物の入札が実施され、最高落札利回0.0501%、按分率10.6809%、平均落札利回0.0465%という結果となった。アウトライト市場は、1M:0.033%、3M:0.044~0.051%での出合い。入札銘柄では高めの水準となっているものの、一般的に小動きとなっており、気配は横ばい圏にとどまっている。CP市場は、落ち着いた環境であることからレートの目線に大きな変化は見当たらない。また、鉄鋼・電機業態から大型発行が実施され、発行総額は1,600億円程度となった。

<< 4日の材料 >>
 *米3月の雇用統計
 *交付税特別会計借入(10,500億円、4/16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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	103.86-87
0.640 0.015	15,071.88 125.56	為替(5時)	103.90-91

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	3/28	3/31	4/1	4/2	4/3
日銀当預残	1,271,700	1,282,000	1,286,700	1,297,800	1,302,500	1,277,800
準備預金残	1,162,900	1,172,000	1,195,000	1,178,500	1,190,100	1,164,100
レート	0.070%	0.069%	0.044%	0.065%	0.064%	0.064%
月中平均	0.07330%	0.07287%	0.07194%	0.06500%	0.06450%	0.06433%

<< オペ情報、入札結果 >>
 全店共通 20,000億円 4/7 ~ 7/18 (102日間) 応札 15,180億円 落札 15,180億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札28兆5,857億8,000万円 落札5兆3,034億5,000万円(非競争入札:4,365億円) 4/7~7/7 0.0501% 按分10.6809% 平均 0.0465%
 10年利付国債(表面利率0.1%) 応札1兆1,573億円 落札3,998億円 4/10~2024/3/10 ▲0.671% 按分60.6012%

「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