

**<<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		2,100	1,500	1,000
財政		▲ 13,500	4,500	1,000
資金過不足		▲ 11,400	6,000	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		15,200		2,200
132,870		▲ 18,000		▲ 2,100
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			15,000	
国庫短期証売却				
国債買入			6,200	5,700
CP等買入				
		▲ 600		
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		100		
国債補完供給				
小計		▲ 3,300	21,200	5,800
当増減		▲ 14,700	27,200	7,800

当座預金残高	1,274,600	4/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,163,100		13,400
積み終了先	984,800	4/8以降の残り所要積立額	
超過準備	973,000	積数	11,500
非準備先残高	111,500	1日平均	1,400
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,884,300		
準備預金進捗率	99.39% (実績)	74.19% (日数)	

<b>4/4のマネタリーベース</b>				<b>2,196,000</b>		
4/4コール	合計	146,825	無担	44,794	有担	102,031
コール前日増減	計	▲ 4,320	無担	▲ 1,179	有担	▲ 3,141

4/7の加重平均レート(速報)			4/4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	
0.055 ~0.145 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)		0.050 ~0.145 (0.066)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.060 ~0.120 (0.073)				0.055 ~0.130 (0.081)		
0.260 ~0.290 (0.270)				0.150 ~0.400 (0.218)		
0.180 (0.180)						
0.220 (0.220)						
0.145 ~0.260 (0.174)		0.08-0.13	-	0.118 ~0.200 (0.159)	有担先日付分	
		0.08-0.13	-			
		0.08-0.13	0.0500	0.118 (0.118)		
		-	0.0350-0.0498			
		-	0.0350			
			1Y			

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	1,301,800	前日比	27,200
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.06%前後の出合いが中心となるであろう。

<< 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は、前営業日比5,000億円減の98兆7,000億円(当座預金残高見込は127兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.065%前後での調達、大手行からは0.055%付近での調達希望で始まった。国庫短期証券の発行日であったものの調達意欲は限られ、一巡後は0.055~0.06%の出合いも見られつつ、本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が見られた程度。

<< 7日のオープン市場動向 >>  
 現先取引S/Nは横ばい圏で推移。短国市場は6M物の入札が実施された。WI取引で0.0498%の出合いが見られたものの、平均利回0.0458%、按分利回0.0478%とやや強めの結果。セカンダリーではショートカバーから0.035%でまとまった出合いが見られた。CP発行市場は約1,400億円の発行。徐々に市場残高が回復し、発行レートはほぼ横ばいながら一部で若干上昇した。CP等買入オペは4,500億円が実施された。新年度からの市場の落ち着きを反映し、平均利回は0.078%と前回は4bp低下した。

<< 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

<b>JGB新発10年債</b>	<b>日経平均株価(終値)</b>	<b>為替(9時)</b>	<b>103.32-33</b>
0.610 ▲ 0.030	14,808.85 ▲ 254.92	為替(5時)	103.12-13

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	4/4	4/7
日銀当預残	1,286,700	1,297,800	1,302,500	1,277,800	1,289,300	1,274,600
準備預金残	1,195,000	1,178,500	1,190,100	1,164,100	1,172,400	1,163,100
レート	0.044%	0.065%	0.064%	0.064%	0.066%	0.065%
月中平均	0.07194%	0.06500%	0.06450%	0.06433%	0.06517%	0.06514%

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通	8,000億円	4/9	~ 7/14 (96日間)	応札	2,190億円	落札	2,190億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
CP買入	4,500億円	4/10		応札	9,420億円	落札	4,440億円	按分レート	0.075%	11.0%	平均落札レート	0.078%
国債買入	4,000億円	4/9		応札	10,236億円	落札	4,010億円	按分利回り較差	-0.019%	96.2%	平均利回り較差	-0.018%
国債買入	1,700億円	4/9		応札	6,032億円	落札	1,704億円	按分利回り較差	-0.013%	7.8%	平均利回り較差	-0.011%

T-Bill6M 応札19兆9,866億円 落札3兆2,206億6,000万円(非競争入札:2,793億円) 4/10~10/10 0.0478% 按分55.0695% 平均0.0458%

ETF買入 116億円 約定日 4/7

「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