

**<<資金需給>>**

単位 億円

	10日需給速報		11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		300	▲ 100	1,000		
財政		▲ 7,500	1,100	▲ 3,000		
資金過不足		▲ 7,200	1,000	▲ 2,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		12,700		3,600		
130,541		▲ 15,100		▲ 3,000		
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				9,000		
CP等買入		4,400	▲ 300			
		▲ 500				
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		1,500	▲ 200	9,600		
当預増減		▲ 5,700	800	7,600		

当座預金残高	1,300,200	4/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,183,300		6,500
積み終了先	1,010,200	4/11以降の残り所要積立額	
超過準備	1,010,200	積数	4,700
非準預先残高	116,900	1日平均	900
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	99.75% (実績)	83.87% (日数)	

<b>4/9のマネタリーベース</b>		<b>2,208,000</b>	
4/9コール	合計	143,117	無担 44,666 有担 98,451
コール前日増減	計	▲ 2,084	無担 ▲ 201 有担 ▲ 1,883

4/10の加重平均レート(速報)				4/9の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.030 ~0.145 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.035 ~0.145 (0.064)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.065 ~0.120 (0.077)					0.065 ~0.120 (0.097)		
0.170 ~0.290 (0.250)					0.065 ~0.200 (0.119)		
0.145 ~0.350 (0.230)		0.08-0.13	-				有担先日付分
		0.08-0.13	-				
		0.08-0.13	0.048-0.0501				
		-	0.030-0.031				
		-	0.0350				

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通	8,000億円	4/14 ~ 7/14 (91日間)	応札 3,570億円	落札 3,570億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	2,500億円	4/14	応札 12,418億円	落札 2,503億円	按分利回り較差 0.005%	75.9%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,500億円	4/14	応札 16,212億円	落札 2,504億円	按分利回り較差 0.005%	86.9%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	4/14	応札 14,282億円	落札 4,005億円	按分利回り較差 0.004%	87.8%	平均利回り較差	0.005%
T-Bill3M	応札29兆5,417億円	落札5兆2,247億円(非競争入札:4,552億円)	4/14~7/14	0.0501%	按分47.2357%	平均0.0481%		

「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

4/11の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,301,000	前日比	800
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは、0.065%前後の出合いが中心となるであろう。

**<< 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は、前日比3,000億円減の101兆2,000億円(当座預金残高見込は130兆3,000億円)。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%での調達希望で始まった。国庫短期証券等の発行日であったものの、高水準の当座預金残高を背景に、終日落ち着いた取引となった。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。

**<< 10日のオープン市場動向 >>**  
現先取引S/Nは横ばい圏での動き。短国市場は3M物の入札が実施された。WI取引では0.048%の出合いが散見されるなか、按分利回りは前回債比同水準の0.0501%と市場予想通りの結果。セカンダリーでは0.048%の出合いとなった。CP発行市場は石油・電機業態などからの発行があり総額1,300億円程度。発行レートは、まとまった額の案件では前回よりやや上昇したのも見られた。

- << 11日の材料 >>**
- \*3月のマネースtock \*3月の企業物価指数
  - \*日銀金融政策決定会合議事要旨(3月10、11日開催分)
  - \*2月の特定サービス産業動態統計速報
  - \*米国3月の生産者物価指数
  - \*米国4月のミシガン大消費者信頼感指数速報
  - \*国庫短期証券入札(2ヶ月、25,000億円、4/15発行)
  - \*30年利付国債入札(7,000億円、4/15発行)

<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>102.12-14</b>
0.605 ▲ 0.010	14,300.12 0.43	為替(5時)	101.72-74

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	4/4	4/7	4/8	4/9	4/10
日銀当預残	1,277,800	1,289,300	1,274,600	1,301,100	1,305,900	1,300,200
準備預金残	1,164,100	1,172,400	1,163,100	1,184,400	1,188,900	1,183,300
レート	0.064%	0.066%	0.065%	0.065%	0.064%	0.065%
月中平均	0.06433%	0.06517%	0.06514%	0.06513%	0.06500%	0.06500%