

<<資金需給>>

単位 億円

	30日需給速報		31日需給予想	1日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	1,000	2,000
財政		10,200	14,200	▲ 7,000
資金過不足		10,400	15,200	▲ 5,000
貸出		▲ 600		
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		67,517		
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証買入			7,500	
国庫短期証売却				
国債買入			10,700	4,200
CP等買入			6,000	
		▲ 700	▲ 8,000	
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			300	
国債補完供給	即日	100		
小計		▲ 1,200	16,500	4,200
当預増減		9,200	31,700	▲ 800

当座預金残高	1,984,000	3/30以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,827,400		20,400
積み終了先	1,502,900	3/31以降の残り所要積立額	
超過準備	1,502,800	積数	17,300
非準備先残高	156,600	1日平均	1,100
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,972,700		
準備預金進捗率	99.12% (実績)	48.39% (日数)	

3/27のマナターベース		2,919,200	
3/27コール	合計	193,799	無担 65,666 有担 128,133
コール前日増減	計	▲ 4,542	無担 ▲ 2,776 有担 ▲ 1,766

3/30の加重平均レート(速報)				3/27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
0.050 ~0.130 (0.064)	0.030	~0.040 (0.031)		0.060 ~0.130 (0.067)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.010 ~0.125 (0.016)						0.061 ~0.121 (0.072)		
						0.020 ~0.060 (0.033)		
0.125 ~0.220 (0.149)						0.065 ~0.190 (0.116)		
0.118 ~0.185 (0.131)								
0.145 (0.145)			0.08-0.13	-				有担先日付分
			0.08-0.12	-				
			0.08-0.12	0.005-0.010				
			-	-				
			-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,070億円	3/30	~ 3/31 (1日間)	応札	1億円	落札	1億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	4,000億円	4/1		応札	12,067億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	0.007%	47.8%	平均利回り較差	0.011%
国債買入	200億円	4/1		応札	643億円	落札	201億円	按分価格較差	-0.270円	72.8%	平均価格較差	-0.342円

「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

3/31の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,015,700	前日比	31,700
O/N	0.01~0.06	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.01~0.06%程度の出合いが中心になると見込まれる。

<< 30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8,000億円増の150兆7,000億円(当座預金残高見込みは過去最高の198兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託から0.06~0.065%程度での調達で始まった。一巡後は、0.06%前後を中心に散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件も含め、ほとんど出合いは見られなかった。

<< 30日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、横ばい圏で推移した。短国市場は、受渡日が期末を越えたことでレートが反転し、3M物が0.005~0.010%と大幅にレート低下しての出合いとなっていた。CP市場は、発行日の中心が期初に該当することから、3月末償還を再調達する動きが多く見られ、発行総額は5,000億円程度となった。償還比では大幅な発行超となり、CPの積極的な活用が多く見られる形となった。

<< 31日の材料 >>
 *2月の毎月勤労統計調査速報 *2月の住宅着工統計
 *米国1月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
 *米国3月のCB消費者信頼感指数
 *米国3月のシカゴPM景況感指数
 *英国10-12月期のGDP確報値
 *ユーロ圏3月の消費者物価指数速報値

JGB新発10年債	0.370	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	19,411.40	125.77	為替(9時)	119.24-26
						為替(5時)	119.67-69

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	3/23	3/24	3/25	3/26	3/27	3/30
日銀当預残	1,921,100	1,938,400	1,968,700	1,969,300	1,974,800	1,984,000
準備預金残	1,764,100	1,781,600	1,809,400	1,814,100	1,828,900	1,827,400
レート	0.065%	0.064%	0.065%	0.065%	0.067%	0.064%
月中平均	0.07387%	0.07346%	0.07312%	0.07281%	0.07221%	0.07193%