

<<資金需給>>

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想		21日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,100	▲ 1,400	▲ 1,000		
財政		▲ 25,100	4,500	▲ 10,000		
資金過不足		▲ 26,200	3,100	▲ 11,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		3,300	7,900	2,900		
129,568		▲ 1,700	▲ 10,200	▲ 2,100		
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						
		▲ 300	▲ 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		1,000				
ETF買入			100			
国債補完供給						
小計		2,300	6,500	800		
当増減		▲ 23,900	9,600	▲ 10,200		

4/18の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,325,300	前日比	9,600
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%近辺での出合いが中心となるであろう。

<< 17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、99兆9,000億円。無担O/Nは地銀、信託業態から0.06~0.065%、大手行、都銀からは0.06%近辺での調達希望。出合いの中心は0.06~0.061%と昨日と同様、静かな立ち上がりとなった。一巡後も0.06%近辺での出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、昨日に続き大手行が1W物0.117%で調達を行った。

<< 17日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは短国3Mの入札を受け、午後にかけて上昇。短国市場は3Mの入札が実施された。WI取引で0.061%の出合いが見られていた中、平均・按分レート共に0.0595%の結果となった。ショートカバーからセカンダリーでは0.055~0.057%の出合いが見られた。CP市場は1,200億円程度の発行。CP等買入オペは4,500億円でオファーされた。買入対象銘柄にノンバンク業態が多く含まれていたことや足元金利の上昇を受け、平均0.082%、按分0.080%と前回比上昇の結果となった。

<< 18日の材料 >>
 *2月の第3次産業活動指数
 *Good Friday (米・ユーロ圏市場休場)

◀コール3月積み期間分の加重平均レート▶			
(土日を含む)	無担	0.06768%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06714%	有担 0.04100%

当座預金残高	1,315,700	4/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,192,800		1,047,400
積み終了先	557,600	4/18以降の残り所要積立額	
超過準備	420,600	積数	465,400
非準預先残高	122,900	1日平均	16,600
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)			1,842,000
準備預金進捗率	74.73%	(実績)	6.67% (日数)

JGB新発10年債	0.605	0.000	日経平均株価(終値)	14,417.53	▲ 0.15	為替(9時)	102.21-23
						為替(5時)	102.02-04

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	4/10	4/11	4/14	4/15	4/16	4/17
日銀当預残	1,300,200	1,301,500	1,301,100	1,319,400	1,339,600	1,315,700
準備預金残	1,183,300	1,183,000	1,187,200	1,217,600	1,213,500	1,192,800
レート	0.065%	0.065%	0.065%	0.064%	0.064%	0.064%
月中平均	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06493%	0.06488%	0.06482%

4/16のマネタリーベース					
4/16コール	合計	150,299	無担	52,004	有担 98,295
コール前日増減	計	8,176	無担	9,597	有担 ▲ 1,421

4/17の加重平均レート(速報)				4/16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	短国	無担当日分		有担当日分
0.055 ~ 0.145 (0.064)	0.040	~ 0.050 (0.041)				O/N 0.050 ~ 0.080 (0.064)		0.040 ~ 0.050 (0.041)
0.060 ~ 0.120 (0.080)						T/N	0.060 ~ 0.125 (0.088)	
						S/N		
0.117 ~ 0.340 (0.125)						1W	0.117 ~ 0.130 (0.117)	
						2W	0.330 (0.330)	
						3W		
0.150 ~ 0.295 (0.223)				0.08-0.13	-	1M	0.090 ~ 0.250 (0.127)	有担先日付分
				0.08-0.13	-	2M		
0.100 (0.100)				0.08-0.13	0.055-0.061	3M		
				-	-	6M		
				-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>
 全店共通 8,000億円 4/21 ~ 7/22 (92日間) 応札 2,850億円 落札 2,850億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 CP買入 4,500億円 4/22 応札 9,924億円 落札 4,465億円 按分レート 0.080% 84.2% 平均落札レート 0.082%
 T-Bill3M 応札27兆9,902億円 落札5兆2,325億4,000万円(非競争入札:4,374億1,000万円) 4/21~7/22 0.0595% 按分 60.9836% 平均 0.0595%
 20年利付国債(表面利率1.5%) 応札4兆3,754億円 落札1兆954億円(I非競争入札:1,033億円) 4/21~2034/3/20 1.474% 按分53.9008% 平均1.468%

「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