

<<資金需給>>

単位 億円

	18日需給速報		21日需給予想		22日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,500	100	▲ 2,000		
財政		4,500	▲ 18,300	3,000		
資金過不足		3,000	▲ 18,200	1,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		7,900	2,900			
127,231		▲ 10,200	▲ 2,100			
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入					20,000	
国庫短期証売却						
国債買入		9,100		5,700		
CP等買入				4,500		
		▲ 400	▲ 100			
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		6,500	700	30,200		
当預増減		9,500	▲ 17,500	31,200		

当座預金残高	1,325,200	4/18以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,203,100		465,400
積み終了先	986,100	4/21以降の残り所要積立額	
超過準備	898,600	積数	120,600
非準預先残高	122,100	1日平均	4,800
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	93.45% (実績)	16.67% (日数)	

4/17のマネタリーベース		2,217,500	
4/17コール	合計	157,431	無担 60,138 有担 97,293
コール前日増減	計	7,132	無担 8,134 有担 ▲ 1,002

4/18の加重平均レート(速報)			4/17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	無担先日付分	有担当日分
0.050 ~0.145 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.055 ~0.145 (0.064)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.055 ~0.120 (0.078)				T/N	0.060 ~0.120 (0.080)	
				S/N		
0.117 ~0.400 (0.149)				1W	0.117 ~0.340 (0.122)	
				2W		
				3W		
		0.08-0.13	-	1M	0.295 (0.295)	0.150 (0.150)
		0.08-0.13	-	2M		
		0.08-0.13	0.0600	3M		0.100 (0.100)
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	20,000億円	4/22	応札	58,621億円	落札	20,005億円	按分利回り較差	0.003%	43.2%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	4/22	応札	12,246億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	0.005%	45.2%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	1,700億円	4/22	応札	4,422億円	落札	1,704億円	按分利回り較差	0.002%	37.9%	平均利回り較差	0.006%

被災地支援(第36回) 4/24~2015/4/24 (365日間) 貸付予定総額 1億円(大手行1億円、地域金融機関等 0億円) 貸付利率0.10%

<< 4/21の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,307,700	前日比	▲ 17,500
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。

<< 18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、101兆3,000億円。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0.063~0.065%と昨日よりもこじっかりとした立ち上がりとなった。一巡後もさほど調達レートは低下せず、0.061~0.063%での出合いが散見された。ターム物に関しては、昨日に続き大手行が1W物を0.117%で調達を行った。

<< 18日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは高止まりで推移。短国アウトライト市場は短国買入オペが実施された。軟調なマーケットを反映し、平均落札利回較差+0.004%、按分落札利回較差+0.003%と小甘い結果となった。CP市場は閑散。発行総額は800億円程度。残高の多い銘柄ではレート上昇が見られたものの、a-1+格では低下するなど動きはまちまちであった。

<< 21日の材料 >>
 *3月の貿易統計
 *Easter Monday (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%

JGB新発10年債	0.600	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	14,516.27	98.74	為替(9時)	102.44-46
						為替(5時)	102.40-41

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	4/11	4/14	4/15	4/16	4/17	4/18
日銀当預残	1,301,500	1,301,100	1,319,400	1,339,600	1,315,700	1,325,200
準備預金残	1,183,000	1,187,200	1,217,600	1,213,500	1,192,800	1,203,100
レート	0.065%	0.065%	0.064%	0.064%	0.064%	0.065%
月中平均	0.06500%	0.06500%	0.06493%	0.06488%	0.06482%	0.06485%

「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