

◀資金需給▶

単位 億円

	21日需給速報		22日需給予想	23日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 900	▲ 3,000
財政		▲ 19,000	9,800	1,000
資金過不足		▲ 19,100	8,900	▲ 2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,900		
128,011		▲ 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			5,900	
CP等買入			4,500	
		▲ 100	▲ 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			▲ 100	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		700	29,800	0
当預増減		▲ 18,400	38,700	▲ 2,000

当座預金残高	1,306,800	4/21以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,182,800		120,600
積み終了先	971,000	4/22以降の残り所要積立額	
超過準備	970,800	積数	99,400
非準備先残高	124,000	1日平均	4,100
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	94.60% (実績)		20.00% (日数)

4/18のマナターベース		2,228,600	
4/18コール	合計	159,684	無担 62,406 有担 97,278
コール前日増減	計	2,253	無担 2,268 有担 ▲ 15

4/21の加重平均レート(速報)				4/18の加重平均レート(確報)			
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	有担先日付分
0.055 ~0.145 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.050 ~0.145 (0.065)			0.040 ~0.050 (0.041)
0.060 ~0.120 (0.073)				T/N	0.055 ~0.120 (0.078)		
				S/N			
0.116 ~0.260 (0.118)				1W	0.117 ~0.400 (0.144)		
				2W			
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	-	3M			
		-	0.039-0.04	6M			
		-	-	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

本日は日本銀行による調節はありませんでした。

「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

◀ 4/22の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,345,500	前日比	38,700
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。

◀ 21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、99兆8,000億円。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%前後での調達希望。出合いの中心は0.061~0.063%となった。一巡後はやや調達レートが低下し、0.06%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、大手行が1W物0.117%で調達を行った。

◀ 21日のオープン市場動向 ▶
現先レートS/Nは0.09~0.10%程度と、前週に続いて高めでの推移。短国アウトライト市場は6M:0.039%~0.04%で少額の出合いが見られたが、イベントが無かったこともあり一日を通して閑散な状態が続いた。CP市場は、発行総額が700億円程度と少な目。足元の現先レートがGクレポレート等の影響を受けて高止まりしていることから、発行レートもやや上昇気味となっている。

- ◀ 22日の材料 ▶
- *2月の景気動向指数改訂状況
 - *米国3月の中古住宅販売
 - *流動性供給入札(4,000億円、4/24発行)
 - *交付税特別会計借入(10,500億円、5/2借入)

◀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	0.000	日経平均株価(終値)	14,512.38	▲ 3.89	為替(9時)	102.56-58
						為替(5時)	102.53-55

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	4/14	4/15	4/16	4/17	4/18	4/21
日銀当預残	1,301,100	1,319,400	1,339,600	1,315,700	1,325,200	1,306,800
準備預金残	1,187,200	1,217,600	1,213,500	1,192,800	1,203,100	1,182,800
レート	0.065%	0.064%	0.064%	0.064%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06500%	0.06493%	0.06488%	0.06482%	0.06485%	0.06486%