

<<資金需給>>

単位 億円

	13日需給速報	14日需給予想	15日当社予想
	即日 金額	金額	金額
銀行券	1,300	400	0
財政	▲ 20,500	2,500	54,000
資金過不足	▲ 19,200	2,900	54,000
貸出			
売出手形	0		
本店共通	0		
全店共通	0		
共通(固定)	1,000		
67,408	▲ 900		
国債買現	0		
CP買現	0		
国庫短期証買入		17,500	
国庫短期証売却			
国債買入		11,600	4,700
CP等買入	▲ 100	▲ 300	
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	200		
国債補充供給			
小計	200	28,800	4,700
当預増減	▲ 19,000	31,700	58,700

当座預金残高	2,021,100	4/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,845,200		0
積み終了先	1,526,600	4/14以降の残り所要積立額	
超過準備	1,526,600	積数	0
非準備先残高	175,900	1日平均	0
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額(積数)	1,984,900		
準備預金進捗率	100.00% (実績)	93.55% (日数)	

4/10のマネタリーベース		2,977,200	
4/10コール 合計	196,811 無担	69,969 有担	126,842
コール前日増減 計	▲ 1,768 無担	▲ 4,643 有担	2,875

4/13の加重平均レート(速報)				4/10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	単位(%)
0.010 ~0.125 (0.060)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.020 ~0.125 (0.061)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.055 ~0.130 (0.059)					0.051 ~0.120 (0.061)		
0.076 ~0.125 (0.082)					0.053 ~0.200 (0.093)		
		0.08-0.13	-		0.180	(0.180)	有担先日付分
		0.08-0.12	0.005-0.022				
		0.08-0.12	-		0.125	(0.125)	
0.135 (0.135)		-	-				
		-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	700億円	4/15	応札	2,811億円	落札	708億円	按分利回り較差	0.001%	7.5%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,000億円	4/15	応札	12,444億円	落札	4,009億円	按分利回り較差	-0.010%	83.1%	平均利回り較差	-0.009%
社債買入	750億円	4/17	応札	1,631億円	落札	750億円	按分レート	0.055%	51.7%	平均落札レート	0.087%
T-Bill2M	応札7兆5,503億円	落札2兆3,181億7,000万円(非競争入札:1,818億円)	4/15~6/3	0.0260%	按分41.9569%	平均0.0163%					
ETF買入	365億円	約定日	4/13								
J-REIT買入	12億円	約定日	4/13								

4/14の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,052,800	前日比	31,700
O/N	0.05~0.06	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.05~0.06%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 13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1兆9,000億円減少の152兆8,000億円(当座預金残高見込みは202兆1,000億円)。無担O/Nは先週末同様や強含みとなり、大手行は0.05%、地銀・信託業態から0.055~0.06%前後での調達希望で立ち上がりとなった。一巡後は、ビッド水準がやや低下し、0.05%台半ばの出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物は、閑散な出合いであった。

<< 13日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばい圏での動きとなった。短国市場では2M物(525回)入札が実施された。品薄感が強い中、WI取引では0.005%で出合う場面もみられたものの、落札結果は、平均落札利回り0.0163% 按分落札利回り0.026%とテールが流れる結果となった。入札後は0.02%程度での出合いがみられた。CP市場では、償還総額1,800億円程度に対し、発行総額は1,700億円程度に膨らんだ。発行レートは小幅低下して決着する銘柄が目立った。

<< 14日の材料 >>
 *2月のマネタリーサーベイ
 *米国2月の企業在庫 *米国3月の生産者物価指数 *米国3月の小売売上高
 *英国3月の消費者物価指数
 *5年利付国債入札(25,000億円、4/16発行)

JGB新発10年債	0.340	0.000	日経平均株価(終値)	19,905.46	▲ 2.17	為替(9時)	120.19-21
						為替(5時)	120.63-64

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	4/6	4/7	4/8	4/9	4/10	4/13
日銀当預残	2,000,800	2,037,500	2,045,500	2,039,000	2,040,100	2,021,100
準備預金残	1,838,400	1,870,600	1,872,000	1,868,900	1,861,800	1,845,200
レート	0.057%	0.058%	0.059%	0.059%	0.061%	0.060%
月中平均	0.05733%	0.05743%	0.05763%	0.05778%	0.05858%	0.05869%

「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