

<<資金需給>>

単位 億円

	16日需給速報		17日需給予想	20日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	▲ 1,600	0
財政		▲ 25,900	5,400	▲ 59,000
資金過不足		▲ 26,800	3,800	▲ 59,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				1,300
67,408				▲ 800
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			11,700	
CP等買入				
		▲ 300	▲ 400	
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			800	
ETF買入		300		
国債補完供給				
小計		0	12,100	500
当預増減		▲ 26,800	15,900	▲ 58,500

当座預金残高	2,088,900	4/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,909,100		1,931,600
積み終了先	529,700	4/17以降の残り所要積立額	
超過準備	388,700	積数	743,800
非準預先残高	179,800	1日平均	25,600
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)			1,931,600
準備預金進捗率	61.49%	(実績)	3.33% (日数)

4/15のマナターベース		3,051,300	
4/15コール合計	198,008	無担	69,360
コール前日増減	▲ 3,183	無担	▲ 4,716
		有担	128,648
		有担	1,533

4/16の加重平均レート(速報)				4/15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
0.045 ~0.130 (0.066)	0.030	~0.040 (0.031)		0.045 ~0.125 (0.061)		0.056 ~0.125 (0.081)	0.030 ~0.040 (0.031)	
0.057 ~0.120 (0.070)						0.090 (0.090)		
0.114 ~0.155 (0.118)						0.117 (0.117)		
						0.118 ~0.310 (0.120)		
						0.088 (0.088)		
0.118 ~0.170 (0.151)		0.08-0.13	-					有担先日付分
		0.08-0.12	0.0100					
		0.08-0.12	▲0.03-0.00					
		-	-					
		-	-					

<< 4/17の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,104,800	前日比	15,900
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。

<< 16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2兆4,000億円減額の157兆7,000億円(当座預金残高見込みは208兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.055~0.06%近辺、都銀から0.055%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.059~0.06%近辺の出合いが中心となった。積み初日となったものの、前日までとほぼ変わらない地合いで推移した。一巡後は、0.055~0.058%が出合いの中心となった。ターム物は、1W物の期間で大手行によるまとまった調達が確認された。本日の共通担保資金供給オペは、3M物8,000億円のオファーに対し、応札額1,265億円の札割れとなった。

<< 16日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばい圏で推移した。短国市場では3M物(527回)入札が実施された。入札結果は、按分・平均利回り共に0%と堅調な結果となった。セカンダリーは、ショートカバーから一時▲0.03%の出合いが見られたものの、買い一巡後は0%近辺まで売り戻された。CP市場は5・10日発行ということもあり発行総額は3,500億円程度まで膨らんだ。発行レートは横ばい圏での動きとなった。CP等買入オペが実施され、平均落札利回り0.081%、按分落札利回り0.073%と前回(0.086%・0.080%)から小幅低下した。

- << 17日の材料 >>
 *3月の消費動向調査
 *米国3月の消費者物価指数
 *米国4月のミシガン大消費者信頼感指数速報
 *ユーロ圏3月の消費者物価指数改定値

<<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	0.06181%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06139%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.325	0.000	日経平均株価(終値)	19,885.77	16.01	為替(9時)	119.14-15
						為替(5時)	119.29-31

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	4/9	4/10	4/13	4/14	4/15	4/16
日銀当預残	2,039,000	2,040,100	2,021,100	2,052,300	2,115,700	2,088,900
準備預金残	1,868,900	1,861,800	1,845,200	1,874,600	1,933,800	1,909,100
レート	0.059%	0.061%	0.060%	0.059%	0.061%	0.066%
月中平均	0.05778%	0.05858%	0.05869%	0.05871%	0.05887%	0.05931%

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 4/20 ~ 7/21 (92日間) 応札 1,265億円 落札 1,265億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 CP買入 4,000億円 4/21 応札 7,978億円 落札 3,994億円 按分レート 0.073% 4.4% 平均落札レート 0.081%
 T-Bill3M 応札17兆9,088億円 落札4兆9,962億2,000万円(非競争入札:4,137億円) 4/20~7/21 0.0000% 按分82.0111% 平均0.0000%
 20年利付国債(表面利率1.2%) 応札2兆8,938億円 落札1兆987億円(I非競争入札:1兆987億円) 4/20~2035/3/20 1.078%按分39.7464%平均1.071%
 ETF買入 365億円 約定日 4/16

「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