

<<資金需給>>

単位 億円

	20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
銀行券		▲ 400	▲ 600	▲ 2,000
財政		▲ 69,500	6,800	▲ 13,000
資金過不足		▲ 69,900	6,200	▲ 15,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,300		
67,913		▲ 800		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			27,500	
国庫短期証売却				
国債買入			8,500	
CP等買入			4,000	
		▲ 400	▲ 100	
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			▲ 100	
ETF買入		300	100	
国債補完供給				
小計		400	39,900	0
当預増減		▲ 69,500	46,100	▲ 15,000

当座預金残高	2,035,800	4/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,855,600		63,900
積み終了先	1,510,900	4/21以降の残り所要積立額	
超過準備	1,501,000	積数	39,900
非準備先残高	180,200	1日平均	1,600
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,932,200		
準備預金進捗率	97.93% (実績)	16.67% (日数)	

4/17のマナターベース		3,043,500	
4/17コール	合計	210,031 無担	83,023 有担
127,008			
コール前日増減	計	4,401 無担	4,328 有担
73			

4/20の加重平均レート(速報)				4/17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	単位(%)	
0.045 ~0.125 (0.062)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.050 ~0.125 (0.063)
0.057 ~0.120 (0.070)						T/N	0.050 ~0.121 (0.072)
						S/N	
0.116 ~0.122 (0.118)						1W	0.059 ~0.200 (0.116)
0.180 (0.180)						2W	
						3W	0.310 (0.310)
						1M	0.280 (0.280)
				0.08-0.13	-	2M	
				0.08-0.12	-	3M	
				0.08-0.12	-	6M	
				-	-	1Y	
				-	-		

<<オペ情報、入札結果>>

被災地支援(第48回) 4/24~2016/4/22 (364日間) 貸付予定総額 0億円 貸付利率 0.10%  
 ETF買入 365億円 約定日 4/20  
 J-REIT買入 12億円 約定日 4/20

<< 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	2,081,900	前日比	46,100
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。

<< 20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7兆8,000億円減額の152兆円(当座預金残高見込みは203兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.055%近辺、地銀・信託業態から0.055~0.06%近辺の調達希望が始まり、立ち上がりは0.059~0.06%前後の出合いが中心となった。一巡後はややレート水準を下げ、0.055~0.06%の出合いで推移した。ターム物は、1W物の期間で大手行による幅広い調達が確認された。

<< 20日のオープン市場動向 >>  
 現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は依然需給がタイトで、総じて堅調な地合いであったものの、目立った出合いは確認されず、閑散とした展開が続いていた。CP発行市場は、償還額100億円強に対して、機械業態等からの大型発行案件等が見られたため、発行額は1,000億円程度の規模となった。発行レートの水準には特段の変化は見られなかった。

<< 21日の材料 >>  
 \*2月の景気動向指数改訂状況  
 \*流動性供給入札(5,000億円、4/23発行)  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、4/30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	0.06181%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06139%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.310	▲ 0.025	日経平均株価(終値)	19,634.49	▲ 18.39	為替(9時)	118.83-85
						為替(5時)	118.70-72

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	4/13	4/14	4/15	4/16	4/17	4/20
日銀当預残	2,021,100	2,052,300	2,115,700	2,088,900	2,105,300	2,035,800
準備預金残	1,845,200	1,874,600	1,933,800	1,909,100	1,925,000	1,855,600
レート	0.060%	0.059%	0.061%	0.066%	0.063%	0.062%
月中平均	0.05869%	0.05871%	0.05887%	0.05931%	0.05989%	0.06000%

「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