

<<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 | | ▲ 700 | ▲ 2,000 | ▲ 3,000 |
| 財政 | | 8,700 | ▲ 11,300 | ▲ 2,000 |
| 資金過不足 | | 8,000 | ▲ 13,300 | ▲ 5,000 |
| 貸出 | | | | |
| 売出手形 | | | | |
| 0 | | | | |
| 本店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 全店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 共通(固定) | | | | |
| 67,913 | | | | |
| 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 | ▲ 100 | |
| | | ▲ 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 | | 100 | 300 | |
| 国債補完供給 | 即日 | ▲ 300 | 300 | |
| 小計 | | 39,600 | 500 | 0 |
| 当預増減 | | 47,600 | ▲ 12,800 | ▲ 5,000 |

| | | | |
|---------------------------|-----------|----------------|-------------|
| 当座預金残高 | 2,083,400 | 4/21以降の残り所要積立額 | |
| 準備預金残高 | 1,902,400 | | 39,900 |
| 積み終了先 | 1,563,600 | 4/22以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 1,560,500 | 積数 | 28,400 |
| 非準備先残高 | 181,000 | 1日平均 | 1,200 |
| 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 | 98.53% | (実績) | 20.00% (日数) |

| | | | | |
|--------------|----|---------|----|-----------|
| 4/20のマナターベース | | | | 2,974,300 |
| 4/20コール | 合計 | 211,542 | 無担 | 85,346 |
| | | | 有担 | 126,196 |
| コール前日増減 | 計 | 1,511 | 無担 | 2,323 |
| | | | 有担 | ▲ 812 |

| 4/21の加重平均レート(速報) | | | | 4/20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 | | 有担当日分 |
| 0.050 ~0.130 (0.062) | 0.030 | ~0.040 (0.031) | | | | O/N | 0.045 ~0.125 (0.062) | 0.030 ~0.040 (0.031) |
| 0.057 ~0.120 (0.068) | | | | | | T/N | | |
| | | | | | | S/N | 0.057 ~0.120 (0.070) | |
| 0.064 ~0.260 (0.080) | | | | | | 1W | 0.116 ~0.122 (0.118) | |
| 0.087 ~0.340 (0.099) | | | | | | 2W | 0.180 (0.180) | |
| | | | | | | 3W | 0.116 (0.116) | |
| | | | | 0.08-0.13 | - | 1M | | 有担先日付分 |
| | | | | 0.08-0.12 | - | 2M | | |
| 0.124 (0.124) | | | | 0.08-0.12 | - | 3M | | |
| | | | | - | - | 6M | | |
| | | | | - | - | 1Y | | |

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 4,000億円 4/21 ~ 4/22 (1日間) 応札 252億円 落札 252億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 4/23~4/30 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.630%
 流動性供給 応札 1兆9,364億円 落札 4,990億円 4/23 募入最大利回較差 0.006% 按分 42.0595% 募入平均利回較差 0.004%
 交付税特会 1兆500億円 4/30~10/29 応札 3兆700億円 落札 1兆500億円 0.087% 按分 1.8182% 平均 0.085%

| 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 | 2,070,600 | 前日比 | ▲ 12,800 |
| O/N | 0.055~0.065 | T/N | 0.05~0.12 | S/N | 0.05~0.12 |

無担O/Nは0.055~0.065%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 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、前日比5兆5,000億円増額の157兆5,000億円(当座預金残高見込みは208兆2,000億円)。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%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.06%前後の出合いが中心となった。一巡後は徐々に取り下がり、ややレートを切り下げたものの、0.057~0.06%の出合いで堅調に推移した。ターム物は、証券業態からのロール案件の調達为中心となった。

<< 21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、目ぼしい材料に乏しく、一日を通して閑散としていた。CP発行市場は、償還額1,100億円に対して、自動車業態等から大型の発行案件も見られ、発行規模は償還額とほぼ同程度となった。発行レートは概ね横ばい圏での決着となっていた。

<< 22日の材料 >>

- *3月の貿易統計
- *米国3月の中古住宅販売

| <<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 | 0.305 | ▲ 0.005 | 日経平均株価(終値) | 19,909.09 | 274.60 | 為替(9時) | 119.21-23 |
| | | | | | | 為替(5時) | 119.64-65 |

| 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 | 4/20 | 4/21 |
| 日銀当預残 | 2,052,300 | 2,115,700 | 2,088,900 | 2,105,300 | 2,035,800 | 2,083,400 |
| 準備預金残 | 1,874,600 | 1,933,800 | 1,909,100 | 1,925,000 | 1,855,600 | 1,902,400 |
| レート | 0.059% | 0.061% | 0.066% | 0.063% | 0.062% | 0.062% |
| 月中平均 | 0.05871% | 0.05887% | 0.05931% | 0.05989% | 0.06000% | 0.06010% |

「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