

<<資金需給>>

単位 億円

	23日需給速報		24日需給予想	27日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,800	▲ 2,900	▲ 4,000
財政		▲ 3,300	15,000	▲ 10,000
資金過不足		▲ 6,100	12,100	▲ 14,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,600
67,913				▲ 2,900
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				
		▲ 200	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470				
被災地支援				
3,252			0	
社債等買入		▲ 100	▲ 500	
ETF買入		200		
国債補完供給				
小計		▲ 100	11,000	▲ 300
当預増減		▲ 6,200	23,100	▲ 14,300

当座預金残高	2,064,100	4/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,880,400		22,400
積み終了先	1,549,000	4/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,549,000	積数	19,500
非準備先残高	183,700	1日平均	900
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	98.99% (実績)	26.67% (日数)	

4/22のマナターベース		3,011,700	
4/22コール	合計	212,193	無担 88,062 有担 124,131
コール前日増減	計	▲ 1,269	無担 600 有担 ▲ 1,869

4/23の加重平均レート(速報)			4/22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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.055 ~0.075 (0.063)	0.030 ~0.040 (0.031)		0.050 ~0.125 (0.062)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.062 ~0.130 (0.071)				0.057 ~0.120 (0.066)		
				0.073 (0.073)		
0.117 (0.117)				0.074 ~0.130 (0.114)		
				0.114 (0.114)		
0.114 ~0.115 (0.114)				0.114 (0.114)		
		0.08-0.13				有担先日付分
		0.08-0.12				
		0.08-0.12	▲0.014-▲0.004			
		-				
		-				
		-				

<< 4/24の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,087,200	前日比	23,100
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。					

<< 23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1兆2,000億円減少の154兆9,000億円(当座預金残高見込みは206兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.055%近辺、地銀・信託業態から0.059~0.061%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.06~0.062%の出合いが中心となった。一巡後も堅調な地合いが続き、0.057~0.063%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見られた。

<< 23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、3M物(第528回)の入札が実施され、平均落札利回り▲0.0064%、按分落札利回り▲0.0040%と概ね事前の予想通りの堅調な結果となった。セカンダリーでは、3Mで▲0.0040%の出合いも一時見られたが、引け際には▲0.0140%近辺まで低下した。CP市場は、5・10日発行案件で後倒しにされたものがあり、機械・鉄鋼業態からの大型発行案件が見られた。700億円程度の償還に対して、発行額は2,400億円程度まで膨らんだ。発行レートの水準に特段の変化は見られなかった。

<< 24日の材料 >>
 *中曾日銀副総裁、日本証券アナリスト協会主催国際セミナーにて講演
 *3月の企業向けサービス価格指数
 *米国3月の耐久財新規受注

JGB新発10年債	0.310	0.010	日経平均株価(終値)	20,187.65	53.75	為替(9時)	119.95-96
						為替(5時)	119.87-88

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	4/16	4/17	4/20	4/21	4/22	4/23
日銀当預残	2,088,900	2,105,300	2,035,800	2,083,400	2,070,300	2,064,100
準備預金残	1,909,100	1,925,000	1,855,600	1,902,400	1,884,800	1,880,400
レート	0.066%	0.063%	0.062%	0.062%	0.062%	0.063%
月中平均	0.05931%	0.05989%	0.06000%	0.06010%	0.06018%	0.06030%

<< オペ情報、入札結果 >>
 全店共通 8,000億円 4/27 ~ 7/27 (91日間) 応札 2,640億円 落札 2,640億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 国債補完 686億円 4/23 ~ 4/24 (1日間) 応札 40億円 落札 40億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 T-Bill3M 応札18兆7,058億円 落札4兆9,379億3,000万円(非競争入札:4,420億円) 4/27~7/27 ▲0.0040% 按分63.6910% 平均▲0.0064%
 40年利付国債(表面利率1.4%) 応札1兆320億円 落札3,997億円 4/27~2055/3/20 1.470% 按分33.2167%
 交付税特会 1兆500億円 5/8~11/5 応札2兆7,600億円 落札1兆500億円 0.086% 按分80.0000% 平均0.085%

「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