

◀資金需給▶

単位 億円

	24日需給速報		27日需給予想		28日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 3,000	▲ 1,500	▲ 3,000		
財政		15,300	▲ 9,200	▲ 1,000		
資金過不足		12,300	▲ 10,700	▲ 4,000		
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					25,000	
国庫短期証売却						
国債買入		11,700			5,200	
CP等買入						
		▲ 200	▲ 500			
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470						
被災地支援						
3,251		0				
社債等買入		▲ 500	▲ 100			
ETF買入						
国債補充供給						
小計		11,000	▲ 900		30,200	
当預増減		23,300	▲ 11,600		26,200	

当座預金残高	2,087,400	4/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,901,500		19,500
積み終了先	1,568,300	4/27以降の残り所要積立額	
超過準備	1,566,900	積数	10,600
非準備先残高	185,900	1日平均	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	99.45%	(実績)	36.67% (日数)

4/23のマナターベース				3,008,300		
4/23コール	合計	211,831	無担	86,286	有担	125,545
コール前日増減	計	▲ 362	無担	▲ 1,776	有担	1,414

4/24の加重平均レート(速報)			4/23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	無担先日付分	有担当日分	
0.055 ~ 0.125 (0.065)	0.030 ~ 0.040 (0.031)			O/N	0.055 ~ 0.075 (0.063)	0.030 ~ 0.040 (0.031)	
0.062 ~ 0.130 (0.079)				T/N		0.062 ~ 0.130 (0.071)	
				S/N			
0.114 ~ 0.200 (0.125)				1W		0.117 (0.117)	
0.087 ~ 0.180 (0.109)				2W			
				3W		0.114 ~ 0.115 (0.114)	
		0.08-0.13	-	1M			
		0.08-0.12	-	2M		有担先日付分	
		0.08-0.12	▲0.020-▲0.011	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国短買入	25,000億円	4/28	応札	32,481億円	落札	25,001億円	按分利回り較差	-0.016%	55.2%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	2,400億円	4/28	応札	3,889億円	落札	2,405億円	按分利回り較差	-0.025%	42.4%	平均利回り較差	-0.018%
国債買入	1,400億円	4/28	応札	4,141億円	落札	1,401億円	按分利回り較差	-0.015%	23.1%	平均利回り較差	-0.010%
国債買入	1,400億円	4/28	応札	5,128億円	落札	1,403億円	按分価格較差	-0.110円	9.2%	平均価格較差	-0.186円
CP買入	4,000億円	4/30	応札	8,449億円	落札	3,990億円	全取レート	0.074%		平均落札レート	0.079%
ETF買入	365億円	約定日	4/24								

「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

◀ 4/27の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,075,800	前日比	▲ 11,600
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。

◀ 24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2兆3,000億円減少の157兆2,000億円(当座預金残高見込みは208兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.055~0.058%近辺、地銀・信託業態から0.06~0.065%近辺の調達希望。立ち上がりは0.063~0.065%の出合いが中心。週末要因で強含み、一巡後も0.06~0.065%の出合いで堅調に推移した。ターム物は、閑散な地合いとなった。

◀ 24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。短国市場では、短国買入オペが2兆5,000億円でオファーされ、結果は平均利回り較差が+0.002%、按分利回り較差が▲0.016%と、前回のオペ同様にテールが流れる結果となった。セカンダリーでは、3M▲0.02%で小額の出合いも見られた。CP発行市場は、償還額1,500億円に対し、ほぼ同水準の発行規模となった。ノンバンク業態からの大型発行案件が見られた。発行レートは総じて横ばい圏での決着となった。また、CP等買入オペがオファーされ、平均落札利回り0.079%、全取落札利回り0.074%と前回(0.081%・0.073%)とほぼ同水準の結果であった。

◀ 27日の材料 ▶

*特にありません

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	119.57-58
0.285 ▲ 0.025	20,020.04 ▲ 167.61	為替(5時)	119.28-30

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	4/17	4/20	4/21	4/22	4/23	4/24
日銀当預残	2,105,300	2,035,800	2,083,400	2,070,300	2,064,100	2,087,400
準備預金残	1,925,000	1,855,600	1,902,400	1,884,800	1,880,400	1,901,500
レート	0.063%	0.062%	0.062%	0.062%	0.063%	0.065%
月中平均	0.05989%	0.06000%	0.06010%	0.06018%	0.06030%	0.06085%