

◀資金需給▶

単位 億円

	28日需給速報		30日需給予想		1日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,600	▲ 1,900	▲ 1,000		
財政		▲ 4,800	800	▲ 1,000		
資金過不足		▲ 7,400	▲ 1,100	▲ 2,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		6,000				
130,831		▲ 3,200				
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			3,200		9,000	
CP等買入			4,200			
		▲ 600	▲ 3,900			
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512						
被災地支援						
3,806						
社債等買入						
ETF買入				100		
国債補完供給						
小計		2,200	3,600	34,000		
当預増減		▲ 5,200	2,500	32,000		

当座預金残高	1,334,300	4/28以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,209,900		33,300
積み終了先	1,020,900	4/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,019,900	積数	25,500
非準備先残高	124,400	1日平均	1,600
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)			1,842,000
準備預金進捗率	98.62% (実績)	46.67% (日数)	

4/25のマネタリーベース		2,252,300	
4/25コール	合計	156,262	無担 57,957 有担 98,305
コール前日増減	計	▲ 1,601	無担 ▲ 1,511 有担 ▲ 90

4/28の加重平均レート(速報)				4/25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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	有担先日付分
0.055 ~0.145 (0.067)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.075 (0.067)			0.040 ~0.050 (0.041)
0.067 ~0.120 (0.074)				T/N	0.066 ~0.120 (0.082)		
				S/N			
0.085 ~0.200 (0.096)				1W	0.116 ~0.400 (0.161)		
0.118 ~0.295 (0.122)				2W	0.118 ~0.180 (0.127)		
				3W			
		0.08-0.13	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.13	0.0650	2M			
		0.08-0.13	0.060-0.062	3M	0.120 (0.120)		
		-	-	6M			
		-	0.0350	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国短買入	25,000億円	5/1	応札	49,530億円	落札	25,004億円	按分利回り較差	0.001%	94.0%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	2,500億円	5/1	応札	9,408億円	落札	2,508億円	按分利回り較差	0.001%	33.5%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	2,500億円	5/1	応札	11,962億円	落札	2,507億円	按分利回り較差	0.002%	17.7%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	4,000億円	5/1	応札	13,151億円	落札	4,006億円	按分利回り較差	-0.005%	75.4%	平均利回り較差	-0.004%

ETF買入 116億円 約定日 4/28

J-REIT買入 3億円 約定日 4/28

◀ 4/30の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,336,800	前日比	2,500
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.06~0.07%近辺での出合いが中心となるであろう。

◀ 28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、102兆7,000億円。朝方の無担O/Nは大手行、地銀、信託業態から0.065%での調達希望。出合いの中心は0.065~0.067%と先週末と同様、こじっかりとした立ち上がりとなった。一巡後も調達レートに変化はなく、0.065%近辺での出合いとなった。ターム物に関しては、大手行が2W物0.118%で調達を行った。

◀ 28日のオープン市場動向 ▶
 現先レートは横ばいで推移。短国市場は、短国買入オペが25,000億円実施された。前回オペ比で5,000億円増額されたこともあり、平均利回り較差+0.002%、按分利回り較差+0.001%と、市場実勢通りの落ち着いた結果となった。オペの結果後は3Mが0.060%まで買い進まれた。CP市場は通信、石油、電機業態でまとまった発行が見られ、発行総額は1,900億円程度。発行レートは概ね横ばいながらも、ショートターム物で一部レート上昇が見られる案件もあった。

◀ 29日の材料 ▶
 *昭和の日
 *米国FOMC(1日目) *米国2月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
 *米国4月のCB消費者信頼感指数 *英国1-3月期のGDP速報値

◀ 30日の材料 ▶
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(終了後、直ちに結果公表)
 *経済・物価情勢の展望 *黒田日銀総裁、定例会見
 *3月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.5%)
 *3月の毎月勤労統計調査速報 *3月の住宅着工統計
 *米国FOMC(2日目) *米国1-3月期のGDP速報値
 *米国4月のシカゴPM景況感指数 *ユーロ圏4月の消費者物価指数速報値

JGB新発10年債	0.615	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	14,288.23	▲ 141.03	為替(9時)	102.09-11
						為替(5時)	102.22-23

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	4/21	4/22	4/23	4/24	4/25	4/28
日銀当預残	1,306,800	1,346,000	1,344,100	1,328,800	1,339,500	1,334,300
準備預金残	1,182,800	1,212,900	1,221,300	1,214,700	1,219,000	1,209,900
レート	0.065%	0.065%	0.065%	0.065%	0.067%	0.067%
月中平均	0.06486%	0.06486%	0.06487%	0.06488%	0.06511%	0.06524%

「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。