

<<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		7日需給予想	8日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	3,900	5,000
財政		▲ 42,600	▲ 12,900	2,000
資金過不足		▲ 43,500	▲ 9,000	7,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			2,300	
130,831			▲ 1,300	
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				5,100
CP等買入				
		▲ 200	▲ 500	
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				
国債補完供給				
小計		▲ 200	500	30,100
当預増減		▲ 43,700	▲ 8,500	37,100

当座預金残高	1,320,600	5/2以降の残り所要積立額	19,400
準備預金残高	1,191,000	5/7以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,012,300	積数	11,700
超過準備	1,012,000	1日平均	1,300
非準備先残高	129,600	積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,842,500
準備預金進捗率	99.36% (実績)		70.00% (日数)

5/1のマナターベース		2,283,400	
5/1コール	合計	145,302	無担 49,071 有担 96,231
コール前日増減	計	3,297	無担 4,461 有担 ▲ 1,164

5/2の加重平均レート(速報)				5/1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 ~0.135 (0.067)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.135 (0.065)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.060 ~0.120 (0.078)				T/N	0.065 ~0.120 (0.081)		
				S/N			
0.116 ~0.200 (0.133)				1W	0.150 ~0.400 (0.231)		
0.118 ~0.330 (0.215)				2W	0.116 ~0.290 (0.147)		
				3W			
0.118 (0.118)		0.08-0.13	-	1M	0.115 ~0.118 (0.117)	有担先日付分	
		0.08-0.13	-	2M			
0.117 (0.117)		0.08-0.13	0.056-0.057	3M	0.119 ~0.120 (0.120)		
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	25,000億円	5/8	応札	51,509億円	落札	25,007億円	按分利回り較差	-0.001%	12.5%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	1,100億円	5/8	応札	6,245億円	落札	1,100億円	全取利回り較差	0.010%		平均利回り較差	0.010%
国債買入	4,000億円	5/8	応札	15,050億円	落札	4,005億円	按分利回り較差	-0.004%	38.3%	平均利回り較差	-0.003%
交付税特会	1兆500億円	5/16~11/13	応札	3兆1,209億円	落札	1兆500億200万円	0.100%	按分	63.0633%	平均	0.100%

「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。」

<< 5/7の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,312,100	前日比	▲ 8,500
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.06~0.065%近辺での出合いが中心となるであろう。

<< 2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3兆7,000億円減少の101兆4,000億円(当座預金残高見込みは132兆1,000億円)。本日の無担O/Nは大手行の0.06~0.065%の調達希望で始まった。大手行のビッドに押し出される形で、地銀および信託業態は0.065~0.068%にビッドを切り上げ、総じて同水準での出合いが中心となり、底堅い展開となった。出し取り一巡後も、地合いは変化せず、午後後も引き続き大手行の0.065%ビッドが見られたものの、出し手サイドも限定的であり、調整程度の取引にとどまった。ターム物は動意に乏しく、閑散であった。

<< 2日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは低下。短国市場は、短国買入オペが25,000億円で実施され、平均利回較差±0.000%、按分利回較差-0.001%と市場実勢水準通りの結果となった。オペ後は3M0.056~0.057%の気配。CP市場は入札件数・発行額共に少なく、総額300億円程度の出合いと閑散であった。

<< 7日の材料 >>

- *日銀金融政策決定会合議事要旨(4月7、8日開催分)
- *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
- *米国3月の消費者信用残高

<< コール4月の加重平均レート >>

(土日を含む)	無担	0.06523%	有担	0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06495%	有担	0.04100%

JGB新発10年債	0.605	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	14,457.51	▲ 27.62	為替(9時)	102.28-29
						為替(5時)	102.48-49

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	4/24	4/25	4/28	4/30	5/1	5/2
日銀当預残	1,328,800	1,339,500	1,334,300	1,338,000	1,364,300	1,320,600
準備預金残	1,214,700	1,219,000	1,209,900	1,213,800	1,234,200	1,191,000
レート	0.065%	0.067%	0.067%	0.065%	0.065%	0.067%
月中平均	0.06488%	0.06511%	0.06524%	0.06523%	0.06500%	0.06667%

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り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