

<<資金需給>>

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		3,800	3,800	3,000
財政		▲ 16,000	5,400	4,000
資金過不足		▲ 12,200	9,200	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		
131,861		▲ 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	6,700
CP等買入				
		▲ 500	▲ 100	
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			200	
国債補完供給				
小計		500	30,200	6,700
当預増減		▲ 11,700	39,400	13,700

当座預金残高	1,308,900	5/7以降の残り所要積立額	11,700
準備預金残高	1,184,800	5/8以降の残り所要積立額	積数
積み終了先	1,007,700	積数	10,700
超過準備	1,007,700	1日平均	1,300
非準備先残高	124,100	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	99.42% (実績)		73.33% (日数)

5/2のマナターベース		2,240,600	
5/2コール	合計	149,310	無担 54,375 有担 94,935
コール前日増減	計	4,008	無担 5,304 有担 ▲ 1,296

5/7の加重平均レート(速報)				5/2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	有担先日付分	
0.050 ~0.135 (0.064)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.055 ~0.135 (0.067)		0.040 ~0.050 (0.041)		
0.065 ~0.120 (0.071)				T/N	0.060 ~0.120 (0.078)			
				S/N				
0.117 ~0.220 (0.130)				1W 0.116 (0.116)	0.117 ~0.200 (0.145)			
0.118 (0.118)				2W	0.118 ~0.330 (0.215)			
				3W				
0.075 ~0.200 (0.084)		0.08-0.13	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分		
		0.08-0.13	-	2M				
		0.08-0.13	0.056-0.057	3M	0.117 (0.117)			
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	2,500億円	5/9	応札	8,270億円	落札	2,502億円	按分利回り較差	0.002%	94.3%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	2,500億円	5/9	応札	10,672億円	落札	2,505億円	按分利回り較差	0.002%	76.0%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	1,700億円	5/9	応札	6,463億円	落札	1,712億円	按分利回り較差	-0.005%	87.0%	平均利回り較差	-0.004%
米ドル資金供給(固定金利方式)	5/9~5/15 (6日間)		応札なし	貸付利率		0.590%					
ETF買入	119億円	約定日	5/7								

<< 5/8の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,348,300	前日比	
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。

<< 7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2,000億円減少の101兆2,000億円(当座預金残高見込みは131兆2,000億円)。朝方の無担O/Nのビッドは大手行0.06%、地銀および信託業態0.06~0.065%となり、一部大手行が積極的な調達意欲を見せていた先週末と比較すると、幾分落ち着いた状況。0.062~0.063%近辺での取引が中心となる立ち上がりとなった。出し取り一巡後も0.062%近辺の取引で推移。午後に入ると、ビッドサイドも薄くなる中、0.06%で調整程度の取引が行われ、本日の取引を終えた。ターム物は、大手行が1W0.117%、2W0.118%で調達を行った。

<< 7日のオープン市場動向 >>

現先レートは、先週末比で小幅低下。短国市場では、3M0.056~0.057%で出合いがみられるも、総じて堅調な展開。CP市場は、償還総額1,000億円弱に対し発行総額は700億円程度にとどまった。発行レートは、横ばいから小幅低下での決着が目立っていた。

<< 8日の材料 >>

- *MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
- *ECB定例理事会(金融政策発表あり)
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、5/12発行)
- *10年利付国債入札(24,000億円、5/12発行)

<<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	0.600	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	14,033.45	▲ 424.06	為替(9時)	101.73-74
						為替(5時)	101.53-54

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	4/25	4/28	4/30	5/1	5/2	5/7
日銀当預残	1,339,500	1,334,300	1,338,000	1,364,300	1,320,600	1,308,900
準備預金残	1,219,000	1,209,900	1,213,800	1,234,200	1,191,000	1,184,800
レート	0.067%	0.067%	0.065%	0.065%	0.067%	0.064%
月中平均	0.06511%	0.06524%	0.06523%	0.06500%	0.06667%	0.06629%

「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。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