

<<資金需給>>

単位 億円

	12日需給速報		13日需給予想	14日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		2,700	2,300	2,000
財政		▲ 42,700	▲ 8,700	▲ 3,000
資金過不足		▲ 40,000	▲ 6,400	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,600		
133,191		▲ 1,200		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				20,000
国庫短期証売却				
国債買入			9,100	
CP等買入			3,900	
		▲ 900	▲ 400	
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		600	12,600	20,000
当預増減		▲ 39,400	6,200	19,000

当座預金残高	1,319,100	5/12以降の残り所要積立額	4,400
準備預金残高	1,192,000	5/13以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,016,200	積数	3,000
超過準備	1,016,200	1日平均	1,000
非準備先残高	127,100	積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,850,600
準備預金進捗率	99.84% (実績)		90.00% (日数)

5/9のマネターベース		2,267,800	
5/9コール	合計	152,833	無担 58,008 有担 94,825
コール前日増減	計	491	無担 2,179 有担 ▲ 1,688

5/12の加重平均レート(速報)				5/9の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.055 ~0.135 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.010 ~0.135 (0.065)			
0.065 ~0.120 (0.073)					0.063 ~0.125 (0.078)		
0.117 ~0.400 (0.185)					0.117 ~0.285 (0.139)		
0.118 (0.118)					0.118 ~0.145 (0.118)		
		0.08-0.13	0.0550			0.075 (0.075)	有担先日付分
		0.08-0.13	0.05-0.053				
		0.08-0.13	0.045-0.046				
		-	0.0330				
		-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	5/12	~ 5/13 (1日間)	応札	4億円	落札	4億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	20,000億円	5/14		応札	36,153億円	落札	20,007億円	按分利回り較差	-0.002%	51.4%	平均利回り較差	0.000%

「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

<< 5/13の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,325,300	前日比	6,200
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。

<< 12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3兆6,000億円減少の10兆7,000億円(当座預金残高見込みは13兆1,000億円)。無担O/Nは、先週末の資金ニーズが剥落し、大手行から0.06%付近、地銀および信託業態から0.06~0.065%の調達希望の水準でビッドが並んだ。取引の中心は0.063%となり、やや落ち着いた立ち上がりとなった。出し取り一巡後は0.06~0.062%で軟調に推移していたが、午後に入ると大手行が0.065%近辺での調達意欲を示し、同水準で若干の取引が行われ、本日の取引を終えた。ターム物は大手行が1W物0.117%、2W物0.118%で調達希望を示した。

<< 12日のオープン市場動向 >>

現先S/N物は横ばい圏で推移。短国市場は短国買入オペ2兆円が実施され、平均利回較差±0.000%、按分利回較差-0.002%とほぼ市場実勢通りの結果。オペ後は全般的にレート低下となった。CP市場は償還額900億円程度に対し、鉄鋼・電機業態からのまとまった発行案件が見られ、発行額は1,400億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動き。

<< 13日の材料 >>

- *4月のマネーストック
- *米国3月の企業在庫
- *米国4月の小売売上高
- *30年利付国債入札(6,000億円、5/15発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、5/21借入)

JGB新発10年債	0.605	0.000	日経平均株価(終値)	14,149.52	▲ 50.07	為替(9時)	101.87-89
						為替(5時)	101.89-91

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	5/1	5/2	5/7	5/8	5/9	5/12
日銀当預残	1,364,300	1,320,600	1,308,900	1,349,100	1,358,500	1,319,100
準備預金残	1,234,200	1,191,000	1,184,800	1,216,400	1,228,000	1,192,000
レート	0.065%	0.067%	0.064%	0.065%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06500%	0.06667%	0.06629%	0.06613%	0.06582%	0.06575%