

**<<資金需給>>**

単位 億円

	1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		▲ 2,600	3,900	4,000
財政		▲ 10,200	▲ 45,500	▲ 3,000
資金過不足		▲ 12,800	▲ 41,600	1,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)			1,400	
67,642			▲ 800	
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証買入				22,500
国庫短期証売却				
国債買入				8,200
CP等買入				
		▲ 100	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470				
被災地支援				3,251
社債等買入				
ETF買入		300		
国債補充供給		100		
小計		300	200	30,700
当増減		▲ 12,500	▲ 41,400	31,700

当座預金残高	2,089,700	5/1以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,894,800		6,200
積み終了先	1,572,800	5/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,572,700	積数	1,700
非準備先残高	194,900	1日平均	200
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)			1,939,300
準備預金進捗率	99.91% (実績)		70.00% (日数)

4/30のマネタリーベース		3,058,800	
4/30コール合計	192,801	無担	67,458
コール前日増減	計 ▲ 17,671	無担	▲ 18,745
		有担	125,343
		有担	1,074

5/1の加重平均レート(速報)			4/30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
0.050 ~0.125 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.050 ~0.125 (0.063)	
0.058 ~0.120 (0.069)				T/N	0.060 ~0.120 (0.076)
				S/N	
0.064 ~0.123 (0.106)				1W	0.116 ~0.200 (0.150)
0.118 (0.118)				2W	0.118 ~0.340 (0.118)
				3W	
		0.08-0.13	-	1M	0.630 (0.630)
		0.08-0.12	-	2M	
0.117 (0.117)		0.08-0.12	▲0.02-▲0.004	3M	
		-	-	6M	
		-	-	1Y	

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	4,000億円	5/1 ~ 5/7 (6日間) 応札	7億円	落札	7億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	22,500億円	5/8 応札	40,512億円	落札	22,502億円	按分利回り較差 -0.017%	9.4%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	700億円	5/8 応札	3,067億円	落札	707億円	按分利回り較差 0.004%	33.6%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	3,750億円	5/8 応札	11,321億円	落札	3,757億円	按分利回り較差 0.002%	1.2%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	3,750億円	5/8 応札	9,114億円	落札	3,752億円	按分利回り較差 0.006%	7.7%	平均利回り較差	0.008%
流動性供給	応札 6,707億円	落札 2,995億円	5/8 募入最大利回り較差 0.027%	按分 89.4211%	募入平均利回り較差 0.021%				
ETF買入	365億円	約定日 5/1							

<<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	2,048,300	前日比	▲ 41,400
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。					

<< 1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1兆8,000億円減少の157兆4,000億円(当座預金残高見込みは209兆円)。朝方の無担O/Nは、証券・信託・地銀からは0.06~0.065%の調達希望で始まったものの、出合いは0.066~0.07%と、GWの連休要因から強含みとなった。一巡後も0.065~0.069%で高止まりの出合いが続いていた。ターム物は、1W物で大手行による幅広い調達が見られた。

<< 1日のオープン市場動向 >>  
 現先S/N物は低位横ばい圏で推移した。短国市場は、短国買入オペ2兆2,500億円が実施され、平均利回り較差▲0.004%・按分利回り較差▲0.017%と足切が大きく流れる結果となった。セカンダリー市場では▲0.02~▲0.004%で少額の出合いが見られた。CP市場は、大型連休を控え閑散。一部大型の発行案件が見られたものの、全体の発行は膨らまなかった。発行レートは概ね横ばい圏での取引となった。

<< 4日の材料 >>  
 \*米国3月の製造業新規受注・出荷・在庫  
 \*英国祝日(May Day)

<< 5日の材料 >>  
 \*米国3月の貿易収支 \*米国4月のISM非製造業景況指数

<< 7日の材料 >>  
 \*5月の日銀当座預金増減要因見込み \*4月のマネタリーベース  
 \*英国総選挙  
 \*米国3月の米消費者信用残高

<<コール4月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06123%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06090%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.360	0.035	日経平均株価(終値)	19,531.63	11.62	為替(9時)	119.46-48
						為替(5時)	119.78-80

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	4/23	4/24	4/27	4/28	4/30	5/1
日銀当預残	2,064,100	2,087,400	2,075,600	2,101,400	2,102,200	2,089,700
準備預金残	1,880,400	1,901,500	1,890,300	1,914,500	1,907,700	1,894,800
レート	0.063%	0.065%	0.064%	0.064%	0.063%	0.068%
月中平均	0.06030%	0.06085%	0.06096%	0.06117%	0.06123%	0.06800%

「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