

**<<資金需給>>**

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想		11日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		4,200	4,300	3,000		
財政		▲ 46,400	1,000	0		
資金過不足		▲ 42,200	5,300	3,000		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		1,400		1,600		
68,232		▲ 800		▲ 2,200		
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	7,800		
CP等買入						
		▲ 400	▲ 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						
国債補完供給						
小計		200	30,300	7,200		
当預増減		▲ 42,000	35,600	10,200		

当座預金残高	2,047,700	5/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,861,700		1,700
積み終了先	1,541,200	5/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,540,300	積数	700
非準預先残高	186,000	1日平均	100
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	99.96%	(実績)	73.33% (日数)

5/1のマネタリーベース				3,048,900		
5/1コール	合計	196,396	無担	69,788	有担	126,608
コール前日増減	計	3,595	無担	2,330	有担	1,265

5/7の加重平均レート(速報)				5/1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			
0.055 ~0.130 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.125 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)			
0.058 ~0.120 (0.072)					0.058 ~0.120 (0.069)				
0.060 ~0.175 (0.113)				1W 0.064 (0.064)	0.078 ~0.123 (0.115)				
0.160 (0.160)				2W 0.118 (0.118)					
				3W					
0.080 ~0.185 (0.139)		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12	-	3M	0.117 (0.117)				
		-	-	6M					
		-	-	1Y					

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通	8,000億円	5/11	~ 8/10 (91日間)	応札	1,600億円	落札	1,600億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	4,000億円	5/7	~ 5/8 (1日間)	応札	13億円	落札	13億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	4,000億円	5/11		応札	8,988億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	0.050%	99.1%	平均利回り較差	0.056%
国債買入	2,400億円	5/11		応札	4,988億円	落札	2,401億円	按分利回り較差	0.038%	84.4%	平均利回り較差	0.050%
国債買入	1,400億円	5/11		応札	3,865億円	落札	1,401億円	按分利回り較差	0.035%	61.4%	平均利回り較差	0.045%

ETF買入 361億円 約定日 5/7

J-REIT買入 12億円 約定日 5/7

「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。」

<< 5/8の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,083,300	前日比	35,600
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。

**<< 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3兆5,000億円減少の153兆9,000億円(当座預金残高見込みは204兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、信託・地銀からは0.06%近辺の調達希望で始まり、GWの連休要因が剥落したものの0.064~0.065%の出合いと小高く推移。一巡後も同水準で高止まりの出合いであった。ターム物は、1W物の期間で大手行による調達が見られた。

**<< 7日のオープン市場動向 >>**  
 現先レートS/Nは低位横ばいで推移。短国市場は終日閑散としており、期近債で小額の出合いが見られた程度にとどまった。CP市場は償還総額400億円程度に対し、石油業態でまとまった発行が見られたものの、発行案件が少なく、発行総額は700億円弱程度となった。発行レートは、水準に特段の変化は見られなかった。

- << 8日の材料 >>**
- \*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月の卸売売上高 \*米国4月の雇用統計
  - \*国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、5/12発行)
  - \*10年物物価連動国債入札(5,000億円、5/12発行)
  - \*交付税特別会計借入(10,500億円、5/18借入)

<<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	0.430	0.070	日経平均株価(終値)	19,291.99	▲ 239.64	為替(9時)	119.37-41
						為替(5時)	119.38-40

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	4/27	4/28	4/30	5/1	5/7
日銀当預残	2,087,400	2,075,600	2,101,400	2,102,200	2,089,700	2,047,700
準備預金残	1,901,500	1,890,300	1,914,500	1,907,700	1,894,800	1,861,700
レート	0.065%	0.064%	0.064%	0.063%	0.068%	0.065%
月中平均	0.06085%	0.06096%	0.06117%	0.06123%	0.06800%	0.06757%

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録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