

<<資金需給>>

単位 億円

	8日需給速報		11日需給予想	12日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		4,600	3,400	3,000
財政		1,300	▲ 3,100	▲ 12,000
資金過不足		5,900	300	▲ 9,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,600	
68,232			▲ 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	8,000	
CP等買入				
		▲ 400	▲ 500	
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				
国債補充供給				
小計		30,300	6,900	0
当増増減		36,200	7,200	▲ 9,000

当座預金残高	2,083,900	5/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,896,200		700
積み終了先	1,579,000	5/11以降の残り所要積立額	
超過準備	1,579,000	積数	400
非準備先残高	187,700	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	99.98% (実績)		83.33% (日数)

5/7のマナタリーベース		3,002,700	
5/7コール	合計	206,120	無担 79,876 有担 126,244
コール前日増減	計	9,724	無担 10,088 有担 ▲ 364

5/8の加重平均レート(速報)			5/7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 ~0.125 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.130 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.058 ~0.120 (0.072)				T/N	0.058 ~0.120 (0.072)	
				S/N		
0.116 (0.116)				1W	0.060 ~0.175 (0.114)	
0.180 ~0.310 (0.202)				2W	0.160 (0.160)	
				3W		
0.290 (0.290)		0.08-0.13	-	1M	0.080 ~0.185 (0.139)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.004-▲0.001	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

CP買入 3,500億円 5/13 応札 9,882億円 落札 3,488億円 按分レート 0.082% 42.9% 平均落札レート 0.089%
 T-Bill3M 応札17兆1,059億5,000万円 落札4兆9,341億2,000万円(非競争入札:4,458億円) 5/12~8/10 ▲0.0020% 按分98.7622% 平均▲0.0036%
 10年物債連動国債(表面利率0.1%) 応札1兆3,264億円 落札4,998億円 5/12~2025/3/10 ▲0.589% 按分4.4444%
 交付税特会 1兆500億円 5/18~11/17 応札 3兆1,240億円 落札 1兆500億円 0.085% 按分 84.1270% 平均 0.084%

<< 5/11の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,091,100	前日比	7,200
O/N	0.06~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12
無担O/Nは0.06~0.07%前後での出会いが中心になると見込まれる。					

<< 8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4兆円増加の157兆9,000億円(当座預金残高見込みは208兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、信託・地銀から0.06%近辺の調達希望で始まったものの、立ち上がりは0.066%の出会いと小高く推移。週末要因から徐々に上昇し0.07%の出会いも見られた。一巡後は0.065~0.066%の落ち着いた推移であった。

<< 8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した。短国3M物(530回債)の入札は平均落札利回▲0.0036%、按分落札利回▲0.002%と概ね事前予想通りの堅調な結果となった。セカンダリーは引け際に▲0.004%まで買われた。CP市場は発行案件が少なく、発行総額は300億円弱にとどまった。発行レートに特段の変化は見られなかった。CP等買入オベは3,500億円で実施された。500億円減額されたことや、特定銘柄での売却ニーズの高かったこともあり、各落札利回りは平均0.089%、按分0.082%と前回(0.079%、0.074%)から上昇した。

<< 11日の材料 >>

- *MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
- *米国4月のFRB労働市場情勢指数

<<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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	119.70-73
0.415 ▲0.015	19,379.19 87.20	為替(5時)	120.00-01

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	4/27	4/28	4/30	5/1	5/7	5/8
日銀当預残	2,075,600	2,101,400	2,102,200	2,089,700	2,047,700	2,083,900
準備預金残	1,890,300	1,914,500	1,907,700	1,894,800	1,861,700	1,896,200
レート	0.064%	0.064%	0.063%	0.068%	0.065%	0.068%
月中平均	0.06096%	0.06117%	0.06123%	0.06800%	0.06757%	0.06770%

「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