

<<資金需給>>

単位 億円

	11日需給速報		12日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		3,600	2,800	2,000
財政		▲ 3,900	▲ 12,400	▲ 3,000
資金過不足		▲ 300	▲ 9,600	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,600		
67,672		▲ 2,200		
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		8,000		11,300
CP等買入				3,500
貸出支援基金		▲ 500	▲ 300	
(成長) 46,898				
(増加) 223,470				
被災地支援				
3,251				
社債等買入				
ETF買入			100	
国債補充供給	即日	▲ 200	200	
小計		6,700	0	34,800
当増減		6,400	▲ 9,600	33,800

当座預金残高	2,090,300	5/11以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,903,700		400
積み終了先	1,587,600	5/12以降の残り所要積立額	
超過準備	1,587,600	積数	200
非準備先残高	186,600	1日平均	100
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,951,300		
準備預金進捗率	99.99% (実績)	86.67%	(日数)

5/8のマネタリーベース		3,034,300	
5/8コール	合計	205,158	無担 80,788 有担 124,370
コール前日増減	計	▲ 962	無担 912 有担 ▲ 1,874

5/11の加重平均レート(速報)			5/8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 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.125 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.058 ~0.120 (0.069)				T/N	0.058 ~0.120 (0.072)	
				S/N		
0.065 ~0.130 (0.081)				1W	0.116 (0.116)	
0.180 (0.180)				2W	0.180 ~0.310 (0.202)	
				3W		
0.200 (0.200)		0.08-0.13	-	1M	0.290 (0.290)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.006-▲0.005	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	12,039億円	5/11	~ 5/12 (1日間)	応札	117億円	落札	117億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債補完	16,000億円	5/11	~ 5/12 (1日間)	応札	27億円	落札	27億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	20,000億円	5/13		応札	36,045億円	落札	20,002億円	按分利回り較差	0.001%	99.7%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	3,750億円	5/13		応札	9,501億円	落札	3,765億円	按分利回り較差	-0.004%	73.5%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	3,750億円	5/13		応札	10,360億円	落札	3,755億円	按分利回り較差	-0.008%	41.7%	平均利回り較差	-0.005%
国債買入	2,400億円	5/13		応札	5,040億円	落札	2,403億円	按分利回り較差	-0.030%	10.8%	平均利回り較差	-0.024%
国債買入	1,400億円	5/13		応札	5,222億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	-0.017%	33.3%	平均利回り較差	-0.014%

「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。」

5/12の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,080,700	前日比	▲ 9,600
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%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

<< 11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1兆1,000億円増加の159兆円(当座預金残高見込みは209兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、信託・地銀から0.06%近辺の調達希望が始まった。週末要因が剥落したことで、立ち上がりは0.065%を挟んだ小幅低下の出合いとなった。一巡後もほぼ同程度のレートで出合いが散見された。

<< 11日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは低位横ばいでの推移となった。短国市場は短国買入オペが2兆円でオファーされた。引値が低い銘柄を中心に応札されたと見られ、平均利回り較差+0.002%、按分利回り較差+0.001%という結果となった。CP市場は鉄鋼業態で大型発行案件が見られたものの発行案件が少なく、発行総額は1,100億円程度となった。発行レートに特段の変化は見られなかった。

<< 12日の材料 >>

- *3月の景気動向指数速報
- *4月のマネタリーベースと日本銀行の取引
- *米国4月の財政収支
- *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、5/14発行)
- *10年利付国債入札(24,000億円、5/14発行)

5/8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)	119.80-82
0.390 ▲ 0.025	19,620.91 241.72	為替(5時)	119.98-99

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	4/28	4/30	5/1	5/7	5/8	5/11
日銀当預残	2,101,400	2,102,200	2,089,700	2,047,700	2,083,900	2,090,300
準備預金残	1,914,500	1,907,700	1,894,800	1,861,700	1,896,200	1,903,700
レート	0.064%	0.063%	0.068%	0.065%	0.068%	0.067%
月中平均	0.06117%	0.06123%	0.06800%	0.06757%	0.06770%	0.06764%

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