

◀資金需給▶

単位 億円

	13日需給速報		14日需給予想	15日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		2,000	1,000	1,000
財政		▲ 1,000	▲ 38,800	13,000
資金過不足		1,000	▲ 37,800	14,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		67,672		
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		11,800		4,700
CP等買入		3,500		
		▲ 500	▲ 200	
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	即日	▲ 700	700	
小計		34,100	800	4,700
当増減		35,100	▲ 37,000	18,700

当座預金残高	2,115,300	5/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,926,600		100
積み終了先	1,616,600	5/14以降の残り所要積立額	
超過準備	1,616,500	積数	0
非準備先残高	188,700	1日平均	0
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	100.00% (実績)		93.33% (日数)

5/12のマナタリーベース		3,023,800	
5/12コール 合計	208,197	無担	80,864
コール前日増減	計	有担	127,333
	3,344	無担	1,349
		有担	1,995

5/13の加重平均レート(速報)			5/12の加重平均レート(確報)		
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.045 ~0.075 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)		O/N 0.055 ~0.125 (0.067)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.057 ~0.123 (0.071)			T/N	0.057 ~0.071 (0.069)	
0.090 (0.090)			S/N		
0.062 ~0.130 (0.087)			1W	0.070 ~0.200 (0.087)	
0.310 (0.310)			2W	0.145 (0.145)	
			3W		
		0.08-0.13	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	2M		
		0.08-0.12	3M		
		▲0.003-▲0.002	6M		
		▲0.016-▲0.012	1Y		

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	4,000億円	5/13	~ 5/14 (1日間) 応札	645億円	落札	645億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	700億円	5/15	応札	2,496億円	落札	709億円	按分利回り較差	0.004%	20.5%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	4,000億円	5/15	応札	14,536億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.006%	87.1%	平均利回り較差	-0.005%
社債買入	1,250億円	5/19	応札	1,868億円	落札	1,250億円	按分レート	0.032%	38.3%	平均落札レート	0.083%
ETF買入	361億円	約定日	5/13								

「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。」

◀ 5/14の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,078,300	前日比	▲ 37,000
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。

◀ 13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4兆5,000億円増加の162兆5,000億円(当座預金残高見込みは211兆7,000億円)。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り、立ち上がりは0.065~0.068%の出会いと前日比横ばいで推移した。一巡後も概ね同水準での出会いであった。

◀ 13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。短国市場は特段材料もなく閑散とした中、3M物で▲0.003%~▲0.002%、6M物で▲0.016%~▲0.012%の出会いが見られた程度であった。CP市場は15日発行にあたったことで、幅広い業態で発行が行われ、発行総額は3,100億円程度となった。発行レートは概ね横ばいだった。

◀ 14日の材料 ▶
 *3月の特定サービス産業動態統計速報 *4月のマネーストック
 *米国4月の生産者物価指数
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、5/18発行)
 *30年利付国債入札(8,000億円、5/18発行)

JGB新発10年債	0.450	0.000	日経平均株価(終値)	19,764.72	139.88	為替(9時)	119.85-87
						為替(5時)	119.82-84

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	5/7	5/8	5/11	5/12	5/13
日銀当預残	2,089,700	2,047,700	2,083,900	2,090,300	2,080,200	2,115,300
準備預金残	1,894,800	1,861,700	1,896,200	1,903,700	1,895,300	1,926,600
レート	0.068%	0.065%	0.068%	0.067%	0.067%	0.068%
月中平均	0.06800%	0.06757%	0.06770%	0.06764%	0.06758%	0.06762%

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