

<<資金需給>>

単位 億円

	20日需給速報		21日需給予想		22日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	▲ 1,200	▲ 1,000		
財政		▲ 11,800	▲ 25,700	0		
資金過不足		▲ 12,100	▲ 26,900	▲ 1,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					7,300	
64,873					▲ 3,600	
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						
国庫短期証売却						
国債買入		4,400			11,300	
CP等買入				3,500		
		▲ 400		▲ 100		
貸出支援基金						
(成長) 46,898						
(増加) 223,470						
被災地支援						
3,251					0	
社債等買入						
ETF買入						
国債補完供給						
小計		4,000		3,400		15,000
当預増減		▲ 8,100		▲ 23,500		14,000

当座預金残高	2,110,100	5/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,914,100		95,400
積み終了先	1,586,600	5/21以降の残り所要積立額	
超過準備	1,579,200	積数	74,100
非準預先残高	196,000	1日平均	2,900
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)			2,010,600
準備預金進捗率	96.31%	(実績)	16.13%
		(日数)	

5/19のマナターベース		3,055,900	
5/19コール合計	194,370	無担	67,814
		有担	126,556
コール前日増減	計 8,331	無担	9,070
		有担	▲ 739

5/20の加重平均レート(速報)				5/19の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.050 ~0.125 (0.069)	0.030	~0.040 (0.031)		0.050 ~0.130 (0.069)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.058 ~0.125 (0.080)						0.058 ~0.125 (0.077)		
0.075 ~0.122 (0.110)						0.117 ~0.200 (0.159)		
						0.180 ~0.340 (0.207)		
		0.08-0.13	-			0.280 (0.280)		有担先日付分
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	0.004					
		-	-					
		-	▲0.01					

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	5/22	~ 9/1 (102日間)	応札	7,256億円	落札	7,256億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	3,750億円	5/22		応札	10,612億円	落札	3,752億円	0.005%	74.8%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	3,750億円	5/22		応札	9,815億円	落札	3,754億円	0.003%	94.2%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,400億円	5/22		応札	6,975億円	落札	2,404億円	0.016%	46.8%	平均利回り較差	0.018%
国債買入	1,400億円	5/22		応札	3,685億円	落札	1,405億円	0.013%	64.5%	平均利回り較差	0.017%

「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。」

<< 5/21の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,086,600	前日比	▲ 23,500
O/N	0.06~0.07	T/N	0.055~0.12	S/N	0.055~0.12

無担O/Nは0.06%台後半での出合いが中心になると見込まれる。

<< 20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2兆6,000億円減の159兆5,000億円(当座預金残高見込みは211兆円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.068~0.069%での調達で始まった。国庫短期証券の発行日にあたり、不足地合いであったものの、当座預金残高は高水準を維持している事から、一巡後は、0.065%前後で散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W物0.117%でまとまった調達が見られた。

<< 20日のオープン市場動向 >>
 短国現先レートS/Nは前日からほぼ変化無しであった。短国アウトライト市場では、3M:0.004%、1Y:▲0.01%の出合いが見られた。CP市場は、入札ベースの償還総額1,000億円程度に対し、発行案件に乏しく、発行総額は500億円弱にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

<< 21日の材料 >>
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、22日まで)
 *米国4月の中古住宅販売
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、5/25発行)
 *流動性供給入札(5,000億円、5/25発行)

<<コール4月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06570%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06528%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.395	0.015	日経平均株価(終値)	20,196.56	170.18	為替(9時)	120.64-66
						為替(5時)	120.95-97

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	5/13	5/14	5/15	5/18	5/19	5/20
日銀当預残	2,115,300	2,078,400	2,098,200	2,082,800	2,118,200	2,110,100
準備預金残	1,926,600	1,889,600	1,908,700	1,896,200	1,927,100	1,914,100
レート	0.068%	0.068%	0.070%	0.068%	0.069%	0.069%
月中平均	0.06762%	0.06764%	0.06806%	0.06806%	0.06811%	0.06815%

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