

**<<資金需給>>**

単位 億円

	26日需給速報		27日需給予想	28日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 200	▲ 800	▲ 1,000
財政		16,200	800	▲ 11,000
資金過不足		16,000	0	▲ 12,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		7,200		
72,268		▲ 3,900		
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			11,600	
CP等買入				
		▲ 200	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470				
被災地支援				
3,244				
社債等買入			▲ 300	
ETF買入		200	200	
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		3,200	33,800	0
当増減		19,200	33,800	▲ 12,000

<< 5/27の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,136,600	前日比	33,800
O/N	0.06~0.075	T/N	0.055~0.12	S/N	0.055~0.12

無担O/Nは0.07%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 26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2兆2,000億円増の159兆9,000億円(当座預金残高見込みは210兆4,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07~0.071%での調達で始まった。財政等要因により余剰地合いであったものの、一定の調達ニーズが見られたことで、一巡後も0.065~0.07%で散発的に出合いつつ、本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態の調達となるロール案件が見られた。

<< 26日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは、同水準で推移した。短国市場は、28日の3M物入札を控えて様子見姿勢の参加者が多かったことから、特段出合いは見られなかった。CP市場は、不動産・小売・ノンバンク業態等からまとまった金額の発行が実施されたが、発行レートは概ね横ばい圏であった。

- << 27日の材料 >>  
 \*岩田日銀副総裁、札幌市金融経済懇談会にて講演  
 \*日銀金融政策決定会合議事要旨(4月30日開催分)  
 \*月例経済報告  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、6/4借入)

当座預金残高	2,102,800	5/26以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,913,100		30,200
積み終了先	1,598,100	5/27以降の残り所要積立額	
超過準備	1,597,300	積数	25,300
非準預先残高	189,700	1日平均	1,300
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	98.74% (実績)		35.48% (日数)

JGB新発10年債	0.425	0.005	日経平均株価(終値)	20,437.48	23.71	為替(9時)	121.66-67
						為替(5時)	122.52-53

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	5/19	5/20	5/21	5/22	5/25	5/26
日銀当預残	2,118,200	2,110,100	2,086,100	2,098,900	2,083,600	2,102,800
準備預金残	1,927,100	1,914,100	1,890,900	1,903,600	1,894,700	1,913,100
レート	0.069%	0.069%	0.070%	0.072%	0.069%	0.071%
月中平均	0.06811%	0.06815%	0.06824%	0.06871%	0.06872%	0.06881%

5/25のマナリーベース				3,024,300
5/25コール	合計	201,104	無担	69,811
	有担	131,293		
コール前日増減	計	4,397	無担	447
	有担	3,950		

5/26の加重平均レート(速報)				5/25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 ~ 0.080 (0.071)	0.030	~ 0.040	(0.031)			0.050 ~ 0.075 (0.069)			0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.058 ~ 0.120 (0.074)							0.058 ~ 0.120 (0.075)		
0.075 ~ 0.200 (0.084)							0.090 (0.090)		
0.145 (0.145)							0.065 ~ 0.180 (0.098)		
				0.08-0.13	-				有担先日付分
				0.08-0.12	-				
				0.08-0.12	-				
				-	-				
				-	-				
				-	-				

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完 4,488億円 5/26 ~ 5/27 (1日間) 応札 101億円 落札 101億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)  
 CP買入 2,500億円 5/29 応札 7,849億円 落札 2,485億円 按分レート 0.083% 54.5% 平均落札レート 0.092%  
 20年利付国債(表面利率1.2%) 応札3兆1,701億円 落札1兆895億円(I非競争入札:1,096億円) 5/28~2035/3/20 1.228% 按分30.9090% 平均1.221%

「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