

◀資金需給▶

単位 億円

	9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		2,900	2,500	2,000
財政		0	▲ 40,700	▲ 13,000
資金過不足		2,900	▲ 38,200	▲ 11,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			2,600	
131,861			▲ 1,200	
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		7,000		9,000
CP等買入				3,900
		▲ 500	▲ 900	
貸出支援基金(成長) 33,429 (増加) 85,512				
被災地支援				
3,806				
社債等買入				
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		6,500	600	12,900
当預増減		9,400	▲ 37,600	1,900

当座預金残高	1,358,500	5/9以降の残り所要積立額	9,500
準備預金残高	1,228,000	5/12以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,051,700	積数	4,400
超過準備	1,051,700	1日平均	1,100
非準備先残高	130,500	積み期間(4/16~5/15)の所要準備額(積数)	1,850,600
準備預金進捗率	99.76% (実績)		86.67% (日数)

5/8のマネタリーベース		2,261,300	
5/8コール 合計	152,342	無担	55,829
有担	96,513		
コール前日増減	計 831	無担	1,565
		有担	▲ 734

5/9の加重平均レート(速報)				5/8の加重平均レート(確報)			
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	有担先日付分
0.010 ~0.135 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.055 ~0.135 (0.065)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.063 ~0.125 (0.078)				T/N	0.061 ~0.120 (0.090)		
				S/N			
0.117 ~0.285 (0.173)				1W	0.117 (0.117)		
0.118 ~0.145 (0.118)				2W	0.118 ~0.340 (0.120)		
				3W			
0.075 (0.075)		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.05-0.052	3M	0.250 (0.250)		
		-	0.03-0.04	6M			
		-	0.0300	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	107億円	5/9	~ 5/12 (3日間) 応札	3億円	落札	3億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	2,500億円	5/13	応札	7,372億円	落札	2,506億円	-0.002%	9.5%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	2,500億円	5/13	応札	12,793億円	落札	2,507億円	0.001%	23.6%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	5/13	応札	10,499億円	落札	4,008億円	0.002%	82.3%	平均利回り較差	0.003%

T-Bill6M 応札24兆7,159億円 落札3兆2,216億5,000万円(非競争入札:2,783億円) 5/13~11/10 0.0403% 按分15.7349% 平均0.0383%

◀ 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	1,320,900	前日比	▲ 37,600
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.06~0.065%近辺での出合いが中心となるであろう。

◀ 9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8,000億円増加の105兆3,000億円(当座預金残高見込みは135兆9,000億円)。無担O/Nは、週末日となることもあり、朝方から大手行、地銀、信託が0.065%前後で調達を行う堅調な立ち上がりとなった。出し取り一巡後も、大手行による朝方と同水準での調達希望が見られた。午後も大手行、信託から0.065%前後のビッドが見られたが、調整程度の取引が見られる程度で本日の取引を終えた。ターム物は、大手行が前日に引き続き、1W0.117%、2W0.118%で調達を行った。

◀ 9日のオープン市場動向 ▶  
 現先レートは、発行日要因から小幅上昇。短国市場では6M物の入札が実施された。WI取引において0.04%で出合いがみられており、入札結果は平均落札利回り0.0383%、按分落札利回り0.0403%、按分率15.7349%と強めの結果となった。セカンダリーはショートカバーから0.03%まで買い進まれる場面も見られたが、現状は0.033~0.035%での出合い。CP市場は、償還総額1,000億円程度に対し、発行総額は300億円程度にとどまった。発行レートは横ばい圏での動き。

- ◀ 12日の材料 ▶
- \*3月の国際収支
  - \*4月の景気ウォッチャー調査
  - \*米国4月の財政収支

JGB新発10年債	0.605	0.005	日経平均株価(終値)	14,199.59	35.81	為替(9時)	101.59-60
						為替(5時)	101.70-71

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	4/30	5/1	5/2	5/7	5/8	5/9
日銀当預残	1,338,000	1,364,300	1,320,600	1,308,900	1,349,100	1,358,500
準備預金残	1,213,800	1,234,200	1,191,000	1,184,800	1,216,400	1,228,000
レート	0.065%	0.065%	0.067%	0.064%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06523%	0.06500%	0.06667%	0.06629%	0.06613%	0.06582%

「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