



## &lt;来週の資金需給予想とイベント予定&gt;

(単位: 億円)

日付	資金需給予想			主要要因	オペ曜日	オペスタート	イベント
	銀行券要因	財政等要因	資金過不足				
5/6 (月)				振替休日			欧: ユーロ圏総合PMI (4月) 欧: ユーロ圏PPI (3月)
5/7 (火)	+ 1,300	▲ 43,600	▲ 42,300	国庫短期証券発行償還 (3M) 流動性供給	国債補完供給 CP等買入 + 32,600 ▲ 100		
5/8 (水)	+ 3,000	▲ 3,000	トシ				
5/9 (木)	+ 1,000	▲ 27,000	▲ 26,000	国債発行 (10年)			日: 日銀金融政策決定会合における主な意見 (4月25・26日分) 日: 景気先行CI指数 (3月) 日: 景気一致指数 (3月) 米: 新規失業保険申請件数 (5月4日終了週)
5/10 (金)	+ 2,000	▲ 4,000	▲ 2,000	国庫短期証券発行償還 (6M)			日: 国際収支・経常収支 (3月) 日: 貿易収支 (3月) 日: 景気ウォッチャー調査 (4月)

## &lt;インターバンク&gt;

日銀当座預金残高は週初、前営業日対比+3,800億円の570兆3,400億円から始まった。その後、国債発行や財政等の要因により、2日には、559兆2,700億円 (速報) まで減少し越えた。

無担保コールON物加重平均金利は週初、0.077%から始まった。同金利は月末30日は一部金融機関が調達を見送ったことから0.076%に低下したものの、週を通してビットサイドの調達意欲は底堅く0.076%~0.077%のレンジで推移した。

ターム物は1W~3M物を中心に0.14%~0.20%のレンジで出が見られた。

来週の予定は、国内では、9日に日銀金融政策決定会合における主な意見 (4月25・26日分) の公表、海外では6日にユーロ圏総合PMI (4月)、9日に米新規失業保険申請件数 (5月4日終了週) の公表などがある。

## [無担保コールレート]

	予想レンジ (%)
O/N	0.07 ~ 0.077
1M	0.07 ~ 0.20
2M	0.10 ~ 0.30
3M	0.10 ~ 0.30
6M	0.15 ~ 0.30

## &lt;レポ&gt;

足許GC取引は週初+0.01%~+0.02%を中心に出会い始め、後場には+0.07%近辺まで上昇した。

翌1日は+0.04%~+0.07%のレンジで推移。短国の入札があった週末は+0.06%~+0.07%を中心に、後場には+0.10%近辺の出会いも見られた。

SC取引は2年438~459回債、5年149~167回債、10年350~374回債、20年180~187回債、30年65~82回債、40年13~16回債などに引合いが多く見られた。

## [オープン市場]

	予想レンジ (%)
現先 (on/1w)	0.030 ~ 0.050
CP 3M	0.10 ~ 0.25

## &lt;CP&gt;

今週の入札発行総額は約900億円で、週間償還額の1,900億円を下回った。発行市場はその他金融業、卸売業で発行が見られたものの、大型連休の合間で案件が少なく落ち着いたマーケットであった。入札案件の発行レートは期間1M~3M物で0.10%前半~0.20%近辺での出会いだった。発行残高は先週末時点の24兆408億円から5月1日時点で23兆6,910億円に減少した。

来週の償還額は、約6,400億円となっている。発行市場は、大型連休明けの調達再開により、案件数の増加が見込まれる。発行レートは、引き続き0.10%前半からの出会いが予想される。

## &lt;TDB&gt;

2日の3M (1228回債) の入札は、最高落札利回り0.0344% (前回債0.0148%)、平均落札利回り0.0259% (前回債0.0089%) となった。

来週の入札は、9日に6M、10日に3Mが予定されている。