

**<<資金需給>>**

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,200	1,200	1,000
財政		▲ 22,300	▲ 24,900	▲ 2,000
資金過不足		▲ 21,100	▲ 23,700	▲ 1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		3,400		
118,124		▲ 3,400		
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			9,100	2,600
CP等買入				
		▲ 800	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512				
被災地支援				
3,782				
社債等買入		▲ 100	▲ 200	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 900	28,800	2,600
当預増減		▲ 22,000	5,100	1,600

当座預金残高	1,340,600	6/2以降の残り所要積立額	29,600
準備預金残高	1,223,700	6/3以降の残り所要積立額	24,700
積み終了先	1,045,200	積数	1,900
超過準備	1,045,200	1日平均	1,900
非準備先残高	116,900		
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	1,891,600		
準備預金進捗率	98.69% (実績)	58.06% (日数)	

5/30のマネタリーベース		2,266,200	
5/30コール	合計	153,413	無担 58,347 有担 95,066
コール前日増減	計	▲ 9,553	無担 ▲ 6,934 有担 ▲ 2,619

6/2 の加重平均レート(速報)				5/30 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
0.050 ~0.135 (0.067)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.060 ~0.135 (0.069)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.065 ~0.120 (0.096)				T/N	0.061 ~0.120 (0.075)		
				S/N			
0.117 ~0.400 (0.173)				1W			
0.118 ~0.180 (0.135)				2W			
				3W			
0.150 (0.150)		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.047-0.048	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債買入	1,100億円	6/4	応札	6,772億円	落札	1,100億円	按分利回り較差	0.008%	93.4%	平均利回り較差	0.010%
国債買入	1,500億円	6/4	応札	4,369億円	落札	1,507億円	按分利回り較差	0.011%	23.6%	平均利回り較差	0.014%

「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。」

<< 6/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,345,700	前日比	5,100
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%程度での出合いが中心となろう。

**<< 2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は、前日比8,000億円減少の105兆1,000億円(当座預金残高見込は134兆3,000億円)。無担O/Nは0.065%の出合いで立ち上がり。大手行業態から0.06%、地銀および信託業態から0.06~0.065%前後の調達希望で始まった。国債発行要因等で需給上の不足日ではあったものの、高水準な当座預金残高を背景に落ち着いた展開となり、出し取り一巡後は0.06~0.068%前後で推移し本日の取引を終了した。

**<< 2日のオープン市場動向 >>**  
 現先レートS/Nはレポレートの影響から小高く推移。短国アウトライイト市場は先週の短国買入オペを受けて落ち着いた状況。3Mで0.047~0.048%の出合いが見られた程度であった。CP市場は月初で閑散。300億円程度の発行となり、動意に乏しい展開であった。

- << 3日の材料 >>**
- \*4月の毎月勤労統計調査速報
  - \*5月のマネタリーベース
  - \*6月の日銀当座預金増減要因見込み
  - \*米国4月の製造業新規受注・出荷・在庫
  - \*ユーロ圏5月の消費者物価指数速報値
  - \*10年利付国債入札(24,000億円、6/20発行)
  - \*預金保険機構借入(12カ月程度、6/12借入)

<<コール5月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06739%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06760%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	0.580	0.010	日経平均株価(終値)	14,935.92	303.54	為替(9時)	101.88-89
						為替(5時)	101.98-00

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	5/26	5/27	5/28	5/29	5/30	6/2
日銀当預残	1,322,500	1,356,700	1,357,800	1,354,500	1,362,600	1,340,600
準備預金残	1,199,800	1,228,000	1,230,900	1,224,700	1,238,900	1,223,700
レート	0.068%	0.066%	0.065%	0.070%	0.069%	0.067%
月中平均	0.06731%	0.06726%	0.06718%	0.06728%	0.06739%	0.06800%

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