

<<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想	6日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,000	300	0
財政		▲ 600	4,500	1,000
資金過不足		400	4,800	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
118,124				
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		2,600		9,000
CP等買入		▲ 100	▲ 500	
貸出支援基金 (成長) 33,429 (増加) 85,512				12,000
被災地支援				▲ 10,600
3,782				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		2,400	▲ 500	10,400
当預増減		2,800	4,300	11,400

当座預金残高	1,348,100	6/4以降の残り所要積立額	21,100
準備預金残高	1,223,900	6/5以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,050,400	積数	17,300
超過準備	1,050,200	1日平均	1,600
非準備先残高	124,200	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	99.09% (実績)		64.52% (日数)

6/3のマナターベース		2,246,600	
6/3コール	合計	154,274	無担 58,131 有担 96,143
コール前日増減	計	▲ 1,359	無担 ▲ 802 有担 ▲ 557

6/4の加重平均レート(速報)				6/3の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.055 ~0.075 (0.066)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.035 ~0.075 (0.066)			
0.066 ~0.120 (0.090)					0.065 ~0.120 (0.078)		
0.092 ~0.130 (0.100)					0.073 ~0.200 (0.106)		
0.118 (0.118)					0.117 ~0.330 (0.169)		
		0.08-0.13	-			0.075 (0.075)	有担先日付分
		0.08-0.13	-				
		0.08-0.13	0.043-0.044				
		-	-				
		-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	3,000億円	6/6	応札	17,489億円	落札	3,010億円	按分利回り較差	0.004%	46.6%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	2,000億円	6/6	応札	10,351億円	落札	2,005億円	按分利回り較差	0.003%	15.5%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	6/6	応札	11,850億円	落札	4,011億円	按分利回り較差	0.006%	17.5%	平均利回り較差	0.007%
交付税特会	2兆8,734億円	6/12~12/11	応札	2兆8,734億円	落札	1兆500億円	0.100%	按分	29.9960%	平均	0.098%

<< 6/5の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,352,400	前日比	4,300
O/N	0.05~0.07	T/N	0.05~0.12	S/N	0.05~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心となろう。

<< 4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5,000億円増加の105兆8,000億円(当座預金残高見込は134兆8,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは大手行から0.06%程度、地銀・信託・証券業態から0.065%前後の調達希望で始まった。税揚げ日であったものの取り急ぎ動きはなく、一巡後も昨日と同様に0.063~0.068%近辺で推移し、本日の取引を終了した。

<< 4日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは前日比低下で推移。短国アウトライト市場は品薄感が強い中、店頭見合いの買が見られ、3M物が0.043~0.044%と低下した。CP発行市場は900億円程度の発行。引き続き案件少なく閑散であった。

- << 5日の材料 >>**
- *佐藤日銀審議委員、大分県金融経済懇談会にて講演
 - *MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
 - *ECB定例理事会(金融政策発表あり)
 - *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、6/9発行)
 - *30年利付国債入札(7,000億円、6/20発行)

<<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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.55-57
0.610 0.030	15,067.96 33.71	為替(5時)	102.63-65

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	5/28	5/29	5/30	6/2	6/3	6/4
日銀当預残	1,357,800	1,354,500	1,362,600	1,340,600	1,345,300	1,348,100
準備預金残	1,230,900	1,224,700	1,238,900	1,223,700	1,226,900	1,223,900
レート	0.065%	0.070%	0.069%	0.067%	0.066%	0.066%
月中平均	0.06718%	0.06728%	0.06739%	0.06800%	0.06733%	0.06700%

「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