

<<資金需給>>

単位 億円

	17日需給速報		18日需給予想	19日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	▲ 500	▲ 1,000
財政		4,000	200	2,000
資金過不足		4,200	▲ 300	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
118,159				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			10,000	
国庫短期証売却				
国債買入				
CP等買入				4,000
		▲ 200	▲ 200	
貸出支援基金(成長)				
34,837				
(増加) 85,512				
被災地支援				
3,782				
社債等買入		1,000		
		▲ 100	▲ 100	
ETF買入				
国債補充供給				
小計		700	9,700	4,000
当預増減		4,900	9,400	5,000

当座預金残高	1,394,200	6/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,257,300		1,040,200
積み終了先	696,600	6/18以降の残り所要積立額	
超過準備	487,400	積数	457,000
非準預先残高	136,900	1日平均	16,300
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)			1,841,700
準備預金進捗率	75.19%	(実績)	6.67% (日数)

6/16のマナタリーベース		2,288,500	
6/16コール	合計	157,265	無担 61,891 有担 95,374
コール前日増減	計	4,660	無担 4,519 有担 141

6/17の加重平均レート(速報)				6/16の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.050 ~0.125 (0.066)	0.040	~0.050 (0.041)		0.040 ~0.125 (0.067)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.060 ~0.120 (0.069)					0.065 ~0.120 (0.072)		
0.073 ~0.200 (0.120)					0.117 ~0.400 (0.127)		
0.290 ~0.330 (0.297)							
		0.08-0.13	-	1M		0.118 ~0.150 (0.124)	有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.13	0.0270	3M			
		-	0.0330	6M			
		-	0.0350	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 6/19~6/26 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.600%
 20年利付国債(表面利率1.5%) 応札2兆9,570億円 落札1兆914億円(I非競争入札:1,075億円) 6/20~2034/6/20 1.464% 按分10.5594% 平均1.459%

「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。」

<< 6/18の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,403,600	前日比	9,400
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。

<< 17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4,000億円増加の107兆6,000億円(当預金残高見込みは139兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06~0.063%、地銀・信託業態から0.065~0.067%、証券業態から0.066~0.067%の調達希望。立ち上がりは0.065~0.067%を中心とした出合い。一巡後はやや取り下がる動きも見られたものの、0.06%台前半では底堅くビッドが残ったことから、レートを落とさずに推移した。ターム物では、ロール案件の取引が中心となった。

<< 17日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は品薄感が強いなか、3M0.027%、6M0.033%、1Y0.035%の出合いが少額見られた程度で全般的に閑散。CP市場は、不動産・鉄鋼・ノンバンク業態からまとまった発行案件が見られ、発行額は3,000億円程度まで膨らんだ。先日のCP等買入オペの結果を受け、発行レートの動向が注目されたが、特段波乱なく横ばい圏での推移となった。

<< 18日の材料 >>
 *金融政策決定会合議事要旨(5月20、21日開催分) *5月の貿易統計
 *米国FOMC(2日目)
 *ECB定例理事会(2日目、金融政策発表なし)
 *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、6/20発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、6/26借入)

<<コール5月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06877%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06895%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	101.88-89
0.590 ▲ 0.005	14,975.97 42.68	為替(5時)	102.03-04

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	6/10	6/11	6/12	6/13	6/16	6/17
日銀当預残	1,352,500	1,367,800	1,366,000	1,414,500	1,389,300	1,394,200
準備預金残	1,219,400	1,235,200	1,236,600	1,287,200	1,258,600	1,257,300
レート	0.070%	0.071%	0.071%	0.069%	0.067%	0.066%
月中平均	0.06810%	0.06836%	0.06858%	0.06867%	0.06856%	0.06841%

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