

<<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 | | 無担先日付分 | |
| 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。」

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

<< 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 | 0.590 | ▲ 0.005 | 日経平均株価(終値) | 14,975.97 | 42.68 | 為替(9時) | 101.88-89 |
| | | | | | | 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% |

| 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 | | 無担先日付分 | |
| 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 | | | |