

◀資金需給▶

単位 億円

	20日需給速報		23日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,700	▲ 200	▲ 1,000
財政		50,100	▲ 14,200	2,000
資金過不足		48,400	▲ 14,400	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				20,000
国庫短期証売却				
国債買入		12,200	9,000	
CP等買入				
		▲ 700	▲ 400	
貸出支援基金		49,900		
(成長) 34,837				
(増加) 133,488		▲ 1,900		
被災地支援				
3,782				
社債等買入		▲ 800		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		58,700	8,600	20,000
当預増減		107,100	▲ 5,800	21,000

当座預金残高	1,513,900	6/20以降の残り所要積立額	189,400
準備預金残高	1,365,600	6/23以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,117,500	積数	96,500
超過準備	1,103,300	1日平均	4,200
非準備先残高	148,300	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	94.76% (実績)		23.33% (日数)

6/19のマネタリーベース		2,307,600	
6/19コール	合計	158,654	無担 64,709 有担 93,945
コール前日増減	計	▲ 2,529	無担 ▲ 2,785 有担 256

6/20の加重平均レート(速報)			6/19の加重平均レート(確報)			単位 (%)
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
0.055 ~0.135 (0.066)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.035 ~0.080 (0.066)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.122 (0.068)				T/N	0.067 ~0.120 (0.085)	
				S/N		
0.117 (0.117)				1W 0.067 (0.067)	0.117 ~0.280 (0.126)	
0.116 (0.116)				2W	0.340 (0.340)	
				3W		
0.118 (0.118)		0.08-0.13	-	1M 0.290 (0.290)	0.118 ~0.150 (0.120)	有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M		
		0.08-0.13	0.022-0.033	3M		
		-	0.0300	6M		
		-	0.0300	1Y		

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完	7,205億円	6/20	~	6/23 (3日間)	応札 20億円	落札 20億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債買入	20,000億円	6/24	応札 27,047億円	落札 20,002億円	按分利回り較差	-0.010%	55.1%	平均利回り較差	-0.006%

◀ 6/23の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,508,100	前日比	▲ 5,800
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心となろう。

◀ 20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7兆3,000億円増加の114兆8,000億円(当預金残高見込みは151兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06%近辺、地銀・信託・証券業態から0.065%近辺の調達希望。立ち上がりは0.065~0.066%を中心とした出合い。国債大量償還による資金余剰日ということもあり、一巡後はビッドが薄くなったものの、オファーが入った際には散発的ながらもテイクンされたため、レート水準を大きく落とすことなく推移した。ターム物では、1W~1Mの期間で大手行による調達が見られた。

◀ 20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中、短国買入オペが20,000億円実施され、平均利回り較差▲0.006%、按分利回り較差▲0.010%と需給逼迫懸念から強めの決着となった。オペ後は3M~1Yまで0.020~0.025%の気配となるなど、レートは急低下した。CP市場は、償還額350億円程度に対し、電機・電力業態からまとまった発行案件が見られたことで、発行額は2,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは引続き小幅低下で推移。

◀ 23日の材料 ▶
 *米国5月の中古住宅販売

JGB新発10年債	0.580	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	15,349.42	▲ 11.74	為替(9時)	101.91-93
						為替(5時)	101.91-92

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	6/13	6/16	6/17	6/18	6/19	6/20
日銀当預残	1,414,500	1,389,300	1,394,200	1,404,400	1,406,800	1,513,900
準備預金残	1,287,200	1,258,600	1,257,300	1,264,900	1,265,000	1,365,600
レート	0.069%	0.067%	0.066%	0.068%	0.066%	0.066%
月中平均	0.06867%	0.06856%	0.06841%	0.06839%	0.06826%	0.06795%

「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録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