

## <<資金需給>>

単位 億円

	23日需給速報		24日需給予想		25日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 1,500	▲ 2,000		
財政		▲ 14,200	3,300	2,000		
資金過不足		▲ 14,600	1,800	0		
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		9,000		5,300		
CP等買入		▲ 400	▲ 200			
貸出支援基金(成長)						
34,837						
(増加) 133,488						
被災地支援						
3,782						
社債等買入			▲ 100			
ETF買入						
国債補完供給	即日	▲ 100	100			
小計		8,500	19,800	5,300		
当預増減		▲ 6,100	21,600	5,300		

当座預金残高	1,507,800	6/23以降の残り所要積立額	96,500
準備預金残高	1,363,600	6/24以降の残り所要積立額	80,300
積み終了先	1,117,200	積数	3,600
超過準備	1,117,100	1日平均	3,600
非準備先残高	144,200		
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	95.64% (実績)	26.67% (日数)	

6/20のマネタリーベース		2,416,300	
6/20コール	合計	162,599	無担 65,950 有担 96,649
コール前日増減	計	3,945	無担 1,241 有担 2,704

6/23 の加重平均レート(速報)				6/20 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 ~0.135 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.055 ~0.135 (0.066)			
0.064 ~0.125 (0.070)					0.065 ~0.122 (0.068)		
0.180 ~0.400 (0.224)					0.117 (0.117)		
					0.116 (0.116)		
0.118 (0.118)		0.08-0.13	-		0.118 (0.118)		有担先日付分
		0.08-0.13	-				
		0.08-0.13	0.0220				
		-	-				
		-	-				

## <<オペ情報、入札結果>>

国債補完	2,000億円	6/23 ~ 6/24 (1日間)	応札 60億円	落札 60億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債買入	4,000億円	6/25	応札 10,400億円	落札 4,002億円	按分利回り較差 0.006%	25.1%	平均利回り較差 0.007%
国債買入	1,000億円	6/25	応札 2,928億円	落札 1,002億円	按分利回り較差 0.003%	29.0%	平均利回り較差 0.005%
国債買入	300億円	6/25	応札 1,672億円	落札 302億円	按分利回り較差 0.001%	54.3%	平均利回り較差 0.003%

被災地支援(第38回) 6/27~2015/6/26 (364日間) 貸付予定総額 546億円(大手行 3億円、地域金融機関等 543億円) 貸付利率 0.100%

J-REIT買入 4億円 約定日 6/23

<< 6/24の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,529,400	前日比	21,600
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。

## << 23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1兆7,000億円減少の113兆1,000億円(当預金残高見込みは150兆8,000億円)。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。資金余剰感は強く、一巡後はすぐに取り下がる動きが見られる一方で、0.06%台前半では底堅くビッドが残ったため、大きくレートを落とすことなく推移した。ターム物では、1W~1M物の期間で大手行による調達が見られた。

## << 23日のオープン市場動向 >>

先週末の短国買入オペ増額の影響で需給が逼迫したため、短国現先レートは低下した。短国市場では売り物に乏しく閑散な地合い。CP市場では、引き合いベースで償還総額2,300億円程度に対し、発行総額は3,500億円程度に膨らんだ。発行レートは、前回より低下方向での決着が目立った。

## << 24日の材料 >>

- \*米国4月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- \*米国5月の新築一戸建て販売件数
- \*米国6月のCB消費者信頼感指数
- \*流動性供給入札(4,000億円、6/26発行)

JGB新発10年債	0.580	0.000	日経平均株価(終値)	15,369.28	19.86	為替(9時)	102.08-09
						為替(5時)	101.87-88

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	6/16	6/17	6/18	6/19	6/20	6/23
日銀当預残	1,389,300	1,394,200	1,404,400	1,406,800	1,513,900	1,507,800
準備預金残	1,258,600	1,257,300	1,264,900	1,265,000	1,365,600	1,363,600
レート	0.067%	0.066%	0.068%	0.066%	0.066%	0.065%
月中平均	0.06856%	0.06841%	0.06839%	0.06826%	0.06795%	0.06783%

「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