

《資金需給》

単位 億円

|                                       | 8日需給速報 |         | 9日需給予想 | 10日当社予想 |
|---------------------------------------|--------|---------|--------|---------|
|                                       | 即日     | 金額      | 金額     | 金額      |
| 銀行券                                   |        | 1,200   | 800    | 0       |
| 財政                                    |        | ▲ 800   | 3,500  | ▲ 8,000 |
| 資金過不足                                 |        | 400     | 4,300  | ▲ 8,000 |
| 貸出                                    |        |         |        |         |
| 売出手形                                  |        | 0       |        |         |
| 本店共通                                  |        | 0       |        |         |
| 全店共通                                  |        | 0       |        |         |
| 共通(固定)                                |        | 700     |        |         |
| 68,017                                |        | ▲ 1,000 |        |         |
| 国債買現                                  |        | 0       |        |         |
| CP買現                                  |        | 0       |        |         |
| 国庫短期証買入                               |        |         | 5,000  |         |
| 国庫短期証売却                               |        |         |        |         |
| 国債買入                                  |        |         | 11,700 |         |
| CP等買入                                 |        | ▲ 200   | ▲ 100  |         |
| 貸出支援基金<br>(成長) 48,511<br>(増加) 223,470 |        |         |        |         |
| 被災地支援                                 |        | 3,244   |        |         |
| 社債等買入                                 |        | ▲ 100   |        |         |
| ETF買入                                 |        | 200     |        |         |
| 国債補充供給                                |        |         |        |         |
| 小計                                    |        | ▲ 400   | 20,100 | 0       |
| 当預増減                                  |        | 0       | 24,400 | ▲ 8,000 |

|                           |           |               |             |
|---------------------------|-----------|---------------|-------------|
| 当座預金残高                    | 2,107,500 | 6/8以降の残り所要積立額 |             |
| 準備預金残高                    | 1,924,500 |               | 2,700       |
| 積み終了先                     | 1,622,700 | 6/9以降の残り所要積立額 |             |
| 超過準備                      | 1,622,700 | 積数            | 1,800       |
| 非準備先残高                    | 183,000   | 1日平均          | 300         |
| 積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数) |           |               | 2,026,700   |
| 準備預金進捗率                   | 99.91%    | (実績)          | 77.42% (日数) |

|             |         |           |            |
|-------------|---------|-----------|------------|
| 6/5のマナターベース |         | 3,047,700 |            |
| 6/5コール 合計   | 199,147 | 無担        | 68,679     |
| コール前日増減     | 計       | ▲ 44      | 無担 ▲ 1,071 |
|             |         |           | 有担 1,027   |

| 6/8の加重平均レート(速報)      |                      |           |               | 6/5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 ~0.080 (0.073) | 0.030 ~0.040 (0.031) |           |               | O/N 0.060 ~0.080 (0.075) |                      | 0.030 ~0.040 (0.031) |  |       |
| 0.074 ~0.120 (0.082) |                      |           |               | T/N                      | 0.067 ~0.120 (0.084) |                      |  |       |
|                      |                      |           |               | S/N                      |                      |                      |  |       |
| 0.175 (0.175)        |                      |           |               | 1W                       | 0.117 (0.117)        |                      |  |       |
|                      |                      |           |               | 2W                       | 0.118 (0.118)        | 0.116 ~0.310 (0.163) |  |       |
|                      |                      |           |               | 3W                       |                      |                      |  |       |
| 0.145 (0.145)        |                      | 0.08-0.13 | -             | 1M                       | 0.170 (0.170)        | 有担先日付分               |  |       |
|                      |                      | 0.08-0.12 | -             | 2M                       |                      |                      |  |       |
|                      |                      | 0.08-0.12 | 0-0.002       | 3M                       |                      |                      |  |       |
|                      |                      | -         | ▲0.015-▲0.005 | 6M                       |                      |                      |  |       |
|                      |                      | -         | -             | 1Y                       |                      |                      |  |       |

《オペ情報、入札結果》

T-Bill6M 応札11兆2,663億2,000万円落札3兆2,104億6,000万円(非競争入札:2,895億円) 6/10~12/10 ▲0.0039%按分26.6229% 平均▲0.0079%  
ETF買入 370億円 約定日 6/8

| 6/9の日銀調節とレート予想 |            |        |           |     |           |
|----------------|------------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節           | 見送り        | 当座預金残高 | 2,131,900 | 前日比 | 24,400    |
| O/N            | 0.06~0.075 | T/N    | 0.06~0.12 | S/N | 0.06~0.12 |

無担O/Nは0.07%近辺での出合いが中心になると予想される。

《 8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、162兆8,000億円(当座預金残高見込みは210兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.074%、大手行からは0.068~0.069%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.074~0.075%となった。一巡後はビッドが薄くなり、0.07%台前半での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

《 8日のオープン市場動向 》

現先S/N物は横ばい圏で推移した。短国市場は6M物の入札が実施され、平均▲0.0079%、按分▲0.0039%と強めの結果となった。セカンダリーでは少額ながら▲0.015%まで買い進まれた。CP市場は、五・十日に係る発行となり、一部大型の発行案件が見られたことで、発行総額は2,000億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

《 9日の材料 》

- \*5月のマネーストック \*5月の消費動向調査
- \*ユーロ圏1-3月期のGDP改定値
- \*米国4月の卸売売上高
- \*流動性供給入札(3,000億円、6/11発行)
- \*交付税特別会計借入(10,500億円、6/18借入)

|           |            |           |           |
|-----------|------------|-----------|-----------|
| JGB新発10年債 | 日経平均株価(終値) | 為替(9時)    | 125.62-64 |
| 0.490     | 0.010      | 20,457.19 | ▲ 3.71    |
|           |            | 為替(5時)    | 125.21-23 |

| 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                             | 6/1       | 6/2       | 6/3       | 6/4       | 6/5       | 6/8       |
| 日銀当座預金                         | 2,111,900 | 2,091,000 | 2,090,500 | 2,094,500 | 2,107,500 | 2,107,500 |
| 準備預金残                          | 1,931,900 | 1,915,600 | 1,912,700 | 1,909,500 | 1,929,300 | 1,924,500 |
| レート                            | 0.073%    | 0.075%    | 0.074%    | 0.073%    | 0.075%    | 0.073%    |
| 月中平均                           | 0.07300%  | 0.07400%  | 0.07400%  | 0.07375%  | 0.07429%  | 0.07413%  |

「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