

**<<資金需給>>**

単位 億円

	18日需給速報		19日需給予想	22日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,800	▲ 1,800	0
財政		1,700	500	19,000
資金過不足		▲ 100	▲ 1,300	19,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				1,100
68,017				▲ 1,100
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入				11,800
CP等買入		▲ 300	▲ 400	
貸出支援基金			3,500	
(成長) 48,511			21,600	
(増加) 223,470			▲ 13,900	
被災地支援				
3,244				
社債等買入			▲ 600	
ETF買入		200	300	
国債補完供給	即日	▲ 200		
		200	200	
小計		▲ 100	10,700	11,800
当預増減		▲ 200	9,400	30,800

当座預金残高	2,227,200	6/18以降の残り所要積立額	192,300
準備預金残高	2,032,600	6/19以降の残り所要積立額	105,700
積み終了先	1,662,800	積数	3,900
超過準備	1,626,700	1日平均	3,900
非準預先残高	194,600	積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,955,500
準備預金進捗率	94.59%	(実績)	10.00%
		(日数)	

<b>6/17のマネタリーベース</b>		<b>3,167,300</b>	
6/17コール	合計	196,955	無担 69,994 有担 126,961
コール前日増減	計	▲ 2,124	無担 1,141 有担 ▲ 3,265

6/18の加重平均レート(速報)			6/17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 ~0.125 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.125 (0.079)					0.072 ~0.074 (0.074)	
0.075 (0.075)					0.064 ~0.130 (0.081)	
					0.130 ~0.160 (0.135)	
0.145 ~0.280 (0.169)		0.08-0.13	-			有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	0-0.001			
		-	-			
		-	▲0.030-▲0.024			
			1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通	8,000億円	6/22 ~ 9/24 (94日間)	応札	1,132億円	落札	1,132億円	0.100%	全取	平均	0.100%	(固定)
国債補完	2,507億円	6/18 ~ 6/19 (1日間)	応札	229億円	落札	229億円	-0.400%	全取	平均	-0.400%	(即)
T-Bill3M	応札17兆2,866億円	落札4兆9,067億9,000万円(非競争入札:4,431億円)	6/22~9/24	0.0019%	按分	1.3559%	平均	0.0000%			
40年利付国債(表面利率1.4%)	応札1兆402億円	落札3,998億円	6/22~2055/3/20	1.590%	按分	10.6666%					
ETF買入	370億円	約定日	6/18								

<< 6/19の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,236,600	前日比	9,400
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%台での出合いが中心になると予想される。

**<< 18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、171兆3,000億円(当座預金残高見込みは、222兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.075%、大手行からは0.069%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.073~0.075%となった。一巡後は調達レートが低下し、0.07%近辺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、ロール案件での出合いが散見される程度であった。共通担保オペに関しては、T+2スタートで9月下旬エンド3M物が8,000億円オファーされた。期落ち額1,091億円に対し、落札額1,132億円と、ほぼ同額が継続される結果となった。

**<< 18日のオープン市場動向 >>**  
 現先取引S/Nは横ばい圏内での出合いが中心。短国市場は3M物の入札が実施された。WI取引で0.00%のまとまった取引が見られていたこともあり、各利回りは平均0%、按分0.0019%と概ね予想通りの結果であった。また、1Y物は次回の短国買入オペを控え▲0.03~▲0.024%と強めの出合いが確認された。CP発行市場は昨日同様20日にかかる取引となったことで、小売・機械業態からのまとまった発行もあり、発行総額は1,800億円程度となった。引き続き期間の短い案件を中心に0.10%近辺の出合いとなった。

**<< 19日の材料 >>**  
 \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)  
 \*黒田日銀総裁、定例会見  
 \*中曽日銀副総裁、全国信用金庫大会にて講演  
 \*4月の景気動向指数改訂状況

<<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	0.07294%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07300%	有担 0.03100%

<b>JGB新発10年債</b>	<b>日経平均株価(終値)</b>	<b>為替(9時)</b>	<b>123.56-57</b>
0.435 ▲ 0.040	19,990.82 ▲ 228.45	為替(5時)	122.85-86

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	6/11	6/12	6/15	6/16	6/17	6/18
日銀当預残	2,117,200	2,120,200	2,198,500	2,226,900	2,227,400	2,227,200
準備預金残	1,930,900	1,943,300	2,013,200	2,031,600	2,029,900	2,032,600
レート	0.074%	0.074%	0.073%	0.073%	0.076%	0.074%
月中平均	0.07545%	0.07514%	0.07500%	0.07488%	0.07494%	0.07489%

「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す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