

<<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
銀行券		▲ 1,400	▲ 1,400	▲ 2,000
財政		2,300	1,000	▲ 4,000
資金過不足		900	▲ 400	▲ 6,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
68,058				
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			8,100	
CP等買入				
		▲ 400	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援				
3,244				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入		100		
国債補完供給	即日	▲ 500		
		800	500	
小計		▲ 100	18,300	0
当預増減		800	17,900	▲ 6,000

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	2,277,200	前日比	17,900
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。

<< 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、171兆9,000億円(当座預金残高見込みは、226兆円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.076%、大手行からは0.07%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.071~0.076%となった。一巡後は調達レートが低下し、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、ロール案件中心の取引となった。

<< 23日のオープン市場動向 >>  
 現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、売り物が見られず終始閑散とした地合いのマーケットとなっていた。CP市場は、3,500億円強の償還に対して、発行は4,000億円程度に膨らむなど活況であった。鉄鋼、ノンバンク業態等からも複数大型案件が実施されていた。発行レートは概ね横ばい圏での決着となった。

<< 24日の材料 >>  
 \*5月の企業向けサービス価格指数  
 \*日銀金融政策決定会合議事要旨(5月21、22日開催分)  
 \*米国1-3月期のGDP確報値

当座預金残高	2,259,300	6/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,063,500		17,000
積み終了先	1,716,300	6/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,713,000	積数	11,200
非準備先残高	195,800	1日平均	500
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	99.43% (実績)		26.67% (日数)

JGB新発10年債	0.465	0.040	日経平均株価(終値)	20,809.42	381.23	為替(9時)	123.41-43
						為替(5時)	123.68-70

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	6/22	6/23
日銀当預残	2,226,900	2,227,400	2,227,200	2,235,800	2,258,500	2,259,300
準備預金残	2,031,600	2,029,900	2,032,600	2,030,700	2,065,500	2,063,500
レート	0.073%	0.076%	0.074%	0.074%	0.073%	0.074%
月中平均	0.07488%	0.07494%	0.07489%	0.07476%	0.07468%	0.07465%

6/22のマナタリーベース				3,202,000		
6/22コール	合計	201,708	無担	70,129	有担	131,579
コール前日増減	計	7,305	無担	6,270	有担	1,035

6/23の加重平均レート(速報)				6/22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		有担当日分	
0.055 ~0.125 (0.074)	0.030	~0.040	(0.031)			O/N	0.030 ~0.130 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.070 ~0.120 (0.077)						T/N		0.070 ~0.120 (0.077)	
						S/N			
0.220 (0.220)						1W	0.117 (0.117)		
						2W	0.114 (0.114)		
						3W			
				0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	-	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 8,000億円 6/23 ~ 6/24 (1日間) 応札 460億円 落札 460億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)  
 米ドル資金供給(固定金利方式) 6/25~7/2 (7日間) 応札 5億2,000万ドル 落札 5億2,000万ドル 貸付利率 0.630%  
 流動性供給 応札 1兆8,370億円 4,992億円 6/25 募入最大利回較差 0.012% 按分 28.3674% 募入平均利回較差 0.009%

「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