

**<<資金需給>>**

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想	26日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,600	▲ 2,200	▲ 3,000
財政		1,000	700	3,000
資金過不足		▲ 600	▲ 1,500	0
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		11,800
CP等買入				
		▲ 300	▲ 1,600	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援				500
3,244				▲ 500
社債等買入			▲ 500	
ETF買入				
国債補充供給	即日	▲ 500		
		500	500	
小計		17,800	▲ 1,600	11,800
当増減		17,200	▲ 3,100	11,800

当座預金残高	2,276,500	6/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,073,300		11,200
積み終了先	1,725,900	6/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,725,900	積数	9,200
非準預先残高	203,200	1日平均	400
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	99.53% (実績)		30.00% (日数)

6/23のマナリーベース		3,204,100	
6/23コール	合計	201,522	無担 69,848 有担 131,674
コール前日増減	計	▲ 186	無担 ▲ 281 有担 95

6/24 の加重平均レート(速報)				6/23 の加重平均レート(確報)			
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	有担先日付分
0.055 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.125 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.072 ~0.120 (0.079)				T/N		0.070 ~0.120 (0.077)	
				S/N			
0.069 ~0.180 (0.107)				1W	0.220 (0.220)		
0.105 (0.105)				2W			
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	▲0.003	2M			
		0.08-0.12	▲0.007-▲0.003	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	15,349億円	6/24	~ 6/25 (1日間) 応札	489億円	落札	489億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	3,750億円	6/26	応札	7,628億円	落札	3,752億円	按分利回り較差	0.002%	31.1%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	6/26	応札	15,194億円	落札	4,000億円	全取利回り較差	0.003%		平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	6/26	応札	13,369億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.004%	74.0%	平均利回り較差	-0.002%

「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。」

<< 6/25の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,273,400	前日比	▲ 3,100
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。

<< 24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、173兆6,000億円(当座預金残高見込みは、過去最高の227兆7,000億円)。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0.073~0.076%となった。一巡後は調達レートが低下し、0.07~0.073%で推移した。なお、一部業態による試し取りが行われ、0.12%台での出合いも見られた。ターム物に関しては、ロール案件中心の取引となった。

<< 24日のオープン市場動向 >>  
 現先レートは横ばいで推移。短国市場は売り物が少なく全般的に閑散な中、3Mが▲0.003%から▲0.007%まで買い進まれた。C市場は通信、食料品、石油業態からまとまった発行があり、発行総額は2,100億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移した。

<< 25日の材料 >>  
 \*米国5月の個人所得・消費支出  
 \*国庫短期証券入札(3ヶ月、54,000億円、6/29発行)  
 \*2年利付国債入札(25,000億円、7/15発行)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	123.87-89
0.455 ▲0.010	20,868.03 58.61	為替(5時)	123.92-95

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	6/17	6/18	6/19	6/22	6/23	6/24
日銀当預残	2,227,400	2,227,200	2,235,800	2,258,500	2,259,300	2,276,500
準備預金残	2,029,900	2,032,600	2,030,700	2,065,500	2,063,500	2,073,300
レート	0.076%	0.074%	0.074%	0.073%	0.074%	0.077%
月中平均	0.07494%	0.07489%	0.07476%	0.07468%	0.07465%	0.07475%

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