

**《資金需給》**

単位 億円

	25日需給速報		26日需給予想	29日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,400	▲ 2,300	0
財政		▲ 300	3,400	2,000
資金過不足		▲ 2,700	1,100	2,000
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				
国庫短期証売却				
国債買入			11,800	
CP等買入				
		▲ 1,600	▲ 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			500	
国債補完供給	即日	▲ 100		
		500	100	
小計		▲ 1,700	11,800	0
当預増減		▲ 4,400	12,900	2,000

当座預金残高	2,272,100	6/25以降の残り所要積立額	9,200
準備預金残高	2,065,700	6/26以降の残り所要積立額	7,000
積み終了先	1,716,900	積数	300
超過準備	1,716,400	1日平均	300
非準備先残高	206,400		
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	99.64% (実績)	33.33% (日数)	

<b>6/24のマナリーベース</b>		<b>3,222,900</b>	
6/24コール	合計	198,992	無担 68,995 有担 129,997
コール前日増減	計	▲ 2,530	無担 ▲ 853 有担 ▲ 1,677

6/25の加重平均レート(速報)				6/24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		
0.030 ~0.125 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.125 (0.077)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.068 ~0.125 (0.088)					0.072 ~0.120 (0.079)			
					0.069 ~0.180 (0.107)			
0.117 (0.117)					0.105 (0.105)			
0.260 (0.260)		0.08-0.13	-					有担先日付分
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	▲0.002-0.002					
		-	-					
		-	-					
		-	-					

**《オペ情報、入札結果》**

国債補完	5,783億円	6/25 ~ 6/26 (1日間)	応札	142億円	落札	142億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
CP買入	4,000億円	6/30	応札	7,923億円	落札	3,985億円	按分利回り較差	0.080%	32.5%	平均利回り較差	0.084%
T-Bill3M	応札14兆9,176億5,000万円	落札4兆9,711億4,000万円(非競争入札:4,488億円)	6/29~9/28	0.0000%	按分	62.7037%	平均	▲0.0012%			
2年利付国債(表面利率0.1%)	応札8兆5,876億円	落札2兆3,127億円(I非競争入札:1,863億円)	7/15~2017/7/15	0.002%	按分	70.2250%	平均	0.001%			
ETF買入	370億円	約定日	6/25								

「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

6/26の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,285,000	前日比	12,900
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。

25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、172兆円(当座預金残高見込みは、227兆3,000億円)。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%前後で推移した。ターム物に関しては、ロール案件中心の取引となった。

25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3ヵ月物の入札が実施された。W I取引で▲0.002~▲0.001%の出合いが見られていたこともあり、平均落札利回▲0.0012%、最高落札利回0.000%と概ね事前予想通りの結果になった。セカンドラリーは0.000~0.002%で推移した。CP市場は月末の前倒し発行が見られ、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圏で推移。CP等買入オペが4,000億円程度で実施され、結果は平均落札利回0.084%、按分落札利回0.080%と前回比(平均0.093%・按分0.087%)で低下した。

26日の材料  
\*5月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比3.4%)  
\*5月の完全失業率(市場予想:3.3%)  
\*5月の有効求人倍率(市場予想:1.17倍)  
\*5月全国・6月都区部消費者物価指数(CPI)  
市場予想:全 国(5月)前年同月比(除く生鮮):+0.0%  
東京都区部(6月)前年同月比(除く生鮮):+0.1%

JGB新発10年債	0.470	0.015	日経平均株価(終値)	20,771.40	▲ 96.63	為替(9時)	123.86-88
						為替(5時)	123.76-77

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	6/18	6/19	6/22	6/23	6/24	6/25
日銀当預残	2,227,200	2,235,800	2,258,500	2,259,300	2,276,500	2,272,100
準備預金残	2,032,600	2,030,700	2,065,500	2,063,500	2,073,300	2,065,700
レート	0.074%	0.074%	0.073%	0.074%	0.077%	0.073%
月中平均	0.07489%	0.07476%	0.07468%	0.07465%	0.07475%	0.07468%