

◀資金需給▶

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想		23日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,400	▲ 1,700	▲ 1,000		
財政		▲ 100	50,400	▲ 15,000		
資金過不足		▲ 1,500	48,700	▲ 16,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
118,159						
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			12,200	9,000		
CP等買入		4,000				
		▲ 100	▲ 700			
貸出支援基金			49,900			
(成長) 34,837						
(増加) 85,512			▲ 1,900			
被災地支援						
3,782						
社債等買入			▲ 800			
ETF買入						
国債補完供給						
小計		3,900	58,700	9,000		
当預増減		2,400	107,400	▲ 7,000		
当座預金残高	1,406,800	6/19以降の残り所要積立額				
準備預金残高	1,265,000	240,700				
積み終了先	1,042,200	6/20以降の残り所要積立額				
超過準備	1,026,100	積数				
非準備先残高	141,800	1日平均				
		7,300				
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,841,700					
準備預金進捗率	89.72%	(実績)				13.33%
		(日数)				

6/18のマネタリーベース		2,303,800	
6/18コール	合計	161,183	無担 67,494 有担 93,689
コール前日増減	計	1,264	無担 2,773 有担 ▲ 1,509

6/19の加重平均レート(速報)				6/18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
0.035 ~0.080 (0.066)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.050 ~0.125 (0.068)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.067 ~0.120 (0.085)				T/N	0.066 ~0.125 (0.090)		
				S/N			
0.067 ~0.280 (0.101)				1W	0.280 (0.280)		
0.340 (0.340)				2W	0.135 ~0.180 (0.169)		
				3W	0.148 (0.148)		
0.118 ~0.290 (0.126)		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.13	0.0330	2M			
		0.08-0.13	0.031-0.0361	3M			
		-	0.0320	6M			
		-	0.033-0.034	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

国債買入	3,000億円	6/23	応札	11,095億円	落札	3,000億円	按分利回り較差	0.003%	98.3%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,000億円	6/23	応札	7,491億円	落札	2,001億円	按分利回り較差	0.000%	88.7%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	4,000億円	6/23	応札	11,377億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.007%	92.8%	平均利回り較差	-0.006%
T-Bill3M	応札27兆7,048億円	落札5兆2,630億4,000万円(非競争入札:4,469億円)	6/23~9/22	0.0361%	按分40.2760%	平均	0.0352%				

「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。」

◀ 6/20の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,514,200	前日比	107,400
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心となろう。

◀ 19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、前日比8,000億円減少の107兆5,000億円(当預金残高見込みは140兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06%近辺、地銀・信託・証券業態から0.065%近辺の調達希望。立ち上がりは0.066%を中心とした出合い。一巡後はビッドが薄くなったものの、0.06%のメガバンクのビッドが下支えとなり底堅く推移した。ターム物では、1W~1M物の期間で大手行による調達が見られた。

◀ 19日のオープン市場動向 ▶  
 現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は3M物の入札が実施された。W I取引で0.036%の出合いが見られるなか、平均落札利回り0.0361%、最高落札利回り0.0352%と事前予想通りの結果となった。セカンダリーでは0.031%まで買い進まれた。CP市場は、ノンバンク業態等によるまとまった発行もあり、総額1,100億円程度の出合い。発行レートは旺盛な運用姿勢から全般的にレート低下。

◀ 20日の材料 ▶  
 \*黒田日銀総裁、全国信用金庫大会にて講演  
 \*月例経済報告

◀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	0.06877%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06895%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	0.590	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	15,361.16	245.36	為替(9時)	101.91-92
						為替(5時)	101.78-79

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	6/12	6/13	6/16	6/17	6/18	6/19
日銀当預残	1,366,000	1,414,500	1,389,300	1,394,200	1,404,400	1,406,800
準備預金残	1,236,600	1,287,200	1,258,600	1,257,300	1,264,900	1,265,000
レート	0.071%	0.069%	0.067%	0.066%	0.068%	0.066%
月中平均	0.06858%	0.06867%	0.06856%	0.06841%	0.06839%	0.06826%

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