

資金需給

単位 億円

	29日需給速報		1日需給予想		2日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 700		900		1,000
財政		700		▲ 18,400		▲ 19,000
資金過不足		0		▲ 17,500		▲ 18,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		7,200		2,100		5,600
74,717		▲ 4,700		▲ 2,200		▲ 11,800
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						4,000
国庫短期証売却						
国債買入		8,200				11,500
CP等買入		2,500				
		▲ 2,800		▲ 500		
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470						
被災地支援		3,244				
社債等買入						
ETF買入						
国債補充供給						
小計		10,400		▲ 600		9,300
当預増減		10,400		▲ 18,100		▲ 8,700
当座預金残高	2,130,200		5/29以降の残り所要積立額			
準備預金残高	1,944,600				19,000	
積み終了先	1,633,400		6/1以降の残り所要積立額			
超過準備	1,632,500		積数		12,000	
非準預先残高	185,600		1日平均		800	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)		2,012,300				
準備預金進捗率	99.40%	(実績)	51.61%	(日数)		

6/1の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,112,100	前日比	▲ 18,100
O/N	0.06~0.075	T/N	0.055~0.12	S/N	0.055~0.12
無担O/Nは0.07%前後での出会いが中心になると見込まれる。					

<< 29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1兆7,000億円増の163兆3,000億円(当座預金残高見込みは、過去最高の213兆2,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.073~0.075%での調達、都銀からは0.068%近辺での調達希望が始まった。週末要因から調達ニーズは強く、その後も0.07%台の出会いが見られるなか本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出会いは見られなかった。

<< 29日のオープン市場動向 >>
現先レートS/Nは、引き続き横ばい圏で推移した。短国市場は、買入オペのオファー類が減額され、4,000億円でおファーされた。オペのアナウンス直後に3Mで0.01%の出会いがみられたものの、結果は平均落札利回較差0.002%、按分利回較差0.001%、按分比率87.4%と落ちていた。CP市場は、石油業態からまとまった発行が実施され、発行総額は1,300億円程度にのびた。発行レートは、6月償還物では若干上昇した。

- << 1日の材料 >>
*1-3月期の法人企業統計調査季報
*5月実績/6月見込み財政資金対民間収支
*米国4月の個人所得・消費支出
*米国4月の建設支出
*米国5月のISM製造業景況指数

《コール5月の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	0.06945%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06928%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	123.80-82
0.390 ▲ 0.005	20,563.15 11.69	為替(5時)	123.74-76

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	5/22	5/25	5/26	5/27	5/28	5/29
日銀当預残	2,098,900	2,083,600	2,102,800	2,135,700	2,119,800	2,130,200
準備預金残	1,903,600	1,894,700	1,913,100	1,942,400	1,927,500	1,944,600
レート	0.072%	0.069%	0.071%	0.074%	0.071%	0.073%
月中平均	0.06871%	0.06872%	0.06881%	0.06900%	0.06907%	0.06945%

5/28のマナターベース		3,062,800	
5/28コール 合計	195,708	無担 64,040	有担 131,668
コール前日増減 計	▲ 761	無担 ▲ 2,841	有担 2,080

5/29の加重平均レート(速報)				5/28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	有担先日付分		
0.055 ~0.125 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.125 (0.071)			0.030 ~0.040 (0.031)		
0.068 ~0.122 (0.085)					0.050 ~0.122 (0.071)				
					0.117 ~0.130 (0.120)				
0.118 (0.118)					0.118 (0.118)				
0.118 (0.118)					0.118 (0.118)				
		0.08-0.13	-					有担先日付分	
		0.08-0.12	-						
		0.08-0.12	0.002-0.010						
		-	-						
		-	-						
		-	-						

オペ情報、入札結果

全店共通	15,000億円	6/2	~ 9/11 (101日間)	応札	5,550億円	落札	5,550億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国短買入	4,000億円	6/2		応札	12,638億円	落札	4,003億円	按分利回り較差	87.4%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	3,750億円	6/2		応札	10,800億円	落札	3,752億円	按分利回り較差	0.001%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	3,750億円	6/2		応札	13,242億円	落札	3,754億円	按分利回り較差	0.004%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,000億円	6/2		応札	14,255億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	0.003%	平均利回り較差	0.005%

- 成長基盤強化(本則第20回) 6/5~2019/6/4 (1,460日間) 貸付予定総額 6,685億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 67先
- 成長基盤強化(本則第12回の借り換え) 6/5~2016/6/3 (364日間) 貸付予定総額 1,281億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 58先
- 成長基盤強化(本則第8回の借り換え) 6/5~2016/6/3 (364日間) 貸付予定総額 877億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 58先
- 成長基盤強化(ABL等特則第16期) 6/5~2019/6/5 (1,461日間) 貸付予定総額 85億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 3先
- 成長基盤強化(ABL等特則第8期の借り換え) 6/5~2017/6/5 (731日間) 貸付予定総額 6億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 4先
- 成長基盤強化(小口特則第13期) 6/5~2019/6/4 (1,460日間) 貸付予定総額 29.07億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 22先
- 成長基盤強化(小口特則第5期の借り換え) 6/5~2016/6/3 (364日間) 貸付予定総額 2.96億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 10先
- 成長基盤強化(小口特則第1期の借り換え) 6/5~2016/6/3 (364日間) 貸付予定総額 7.43億円 貸付利率 0.10% 貸付先数 2先
- 成長基盤強化(米ドル特則第12期) 6/5~2016/6/3 (364日間) 貸付予定総額 44百万ドル 貸付先数 14先
- 成長基盤強化(米ドル特則第8期の借り換え) 6/5~2016/6/3 (364日間) 貸付予定総額 1,999百万ドル 貸付先数 25先
- 成長基盤強化(米ドル特則第4期の借り換え) 6/5~2016/6/3 (364日間) 貸付予定総額 1,318百万ドル 貸付先数 26先

「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の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