

<<資金需給>>

単位 億円

	1日需給速報		2日需給予想	3日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		900	1,100	1,000
財政		▲ 18,600	▲ 30,700	▲ 8,000
資金過不足		▲ 17,700	▲ 29,600	▲ 7,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,100	5,600	
74,557		▲ 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			11,600	4,500
CP等買入				
		▲ 500	▲ 100	
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			▲ 100	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 600	9,200	4,500
当預増減		▲ 18,300	▲ 20,400	▲ 2,500
当座預金残高	2,111,900	6/1以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,931,900			12,000
積み終了先	1,621,700	6/2以降の残り所要積立額		
超過準備	1,621,700			積数 10,700
非準備先残高	180,000			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	99.47%	(実績)	54.84%	(日数)

5/29のマネタリーベース		3,073,900	
5/29コール	合計	195,868	無担 66,681 有担 129,187
コール前日増減	計	160	無担 2,641 有担 ▲ 2,481

6/1の加重平均レート(速報)				5/29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		有担当日分	
0.055 ~0.125 (0.073)	0.030	~0.040 (0.031)					O/N	0.055 ~0.125 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.065 ~0.122 (0.084)					T/N			0.068 ~0.122 (0.085)	
					S/N				
					1W				
0.118 (0.118)					2W			0.118 (0.118)	
0.118 (0.118)					3W			0.118 (0.118)	
				0.08-0.13	-				
				0.08-0.12	-				
				0.08-0.12	▲0.001				
				-	-				
				-	-				
				-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,000億円	6/1	~ 6/2 (1日間)	応札	45億円	落札	45億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	700億円	6/3		応札	3,514億円	落札	701億円	按分利回り較差	0.033%	67.6%	平均利回り較差	0.037%
国債買入	2,400億円	6/3		応札	8,057億円	落札	2,408億円	按分利回り較差	0.015%	35.6%	平均利回り較差	0.017%
国債買入	1,400億円	6/3		応札	3,880億円	落札	1,403億円	按分利回り較差	0.012%	29.0%	平均利回り較差	0.015%
ETF買入	361億円	約定日	6/1									

「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

<<6/2の日銀調節とレート予想>>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,091,500	前日比	▲ 20,400
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%近辺での出合いが中心になると見込まれる。

<<1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、162兆3,000億円(当座預金残高見込みは211兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.072%、大手行からは0.068%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.072~0.073%となった。一巡後も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、大手行が2W物0.118%で調達を行った。

<<1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。短国市場は総じて動意に乏しく、3Mで▲0.001%の出合いが見られた程度であった。CP発行市場は、1,400億円弱の償還額に対して、発行は600億円程度の規模にとどまった。発行レートは、発行残高の増加に伴い、若干上昇基調となっていた。

- <<2日の材料>>
- *4月の毎月勤労統計調査速報
 - *5月のマネタリーベース
 - *6月の日銀当座預金増減要因見込み
 - *米国4月の製造業新規受注・出荷・在庫
 - *ユーロ圏5月の消費者物価指数速報値
 - *10年利付国債入札(24,000億円、6/22発行)

<<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)	
0.400	0.010	20,569.87	6.72	124.24-26	
				124.16-17	

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	5/25	5/26	5/27	5/28	5/29	6/1
日銀当預残	2,083,600	2,102,800	2,135,700	2,119,800	2,130,200	2,111,900
準備預金残	1,894,700	1,913,100	1,942,400	1,927,500	1,944,600	1,931,900
レート	0.069%	0.071%	0.074%	0.071%	0.073%	0.073%
月中平均	0.06872%	0.06881%	0.06900%	0.06907%	0.06945%	0.07300%