

**<<資金需給>>**

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		700	400	▲ 1,000
財政		2,200	▲ 11,800	▲ 3,000
資金過不足		2,900	▲ 11,400	▲ 4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
68,017				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		5,000		
国庫短期証売却				
国債買入		11,700		
CP等買入		3,500		
		▲ 100	▲ 1,300	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (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	即日	▲ 100	100	
小計		20,000	▲ 1,300	0
当預増減		22,900	▲ 12,700	▲ 4,000

当座預金残高	2,130,400	6/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,943,500		1,800
積み終了先	1,642,700	6/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,642,700	積数	1,000
非準備先残高	186,900	1日平均	200
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	2,026,700		
準備預金進捗率	99.95% (実績)	80.65% (日数)	

6/8のマナリーベース		3,046,500	
6/8コール	合計	199,519 無担	69,507 有担
130,012			
コール前日増減	計	372 無担	828 有担
			▲ 456

6/9の加重平均レート(速報)				6/8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 ~0.122 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.080 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.071 ~0.120 (0.086)					0.074 ~0.120 (0.082)		
0.200 (0.200)							
0.142 (0.142)							
		0.08-0.13	-		0.145 ~0.175 (0.160)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-				
		0.08-0.12	0.0010				
		-	▲0.013				
		-	-				

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	6,184億円	6/9	~	6/10 (1日間)	応札	98億円	落札	98億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債補完	4,000億円	6/9	~	6/10 (1日間)	応札	2億円	落札	2億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
米ドル資金供給(固定金利方式)		6/11~6/18 (7日間)	応札	100万ドル	落札	100万ドル	貸付利率	0.640%				
流動性供給	応札	1兆1,291億円	落札	2,999億円	6/11	募入最大利回較差	▲0.005%	按分	60.8066%	募入平均利回較差	▲0.013%	
交付税特会	1兆500億円	6/18~12/17	応札	2兆7,775億円	落札	1兆500億円	0.083%	按分	97.5000%	平均	0.080%	
ETF買入	370億円	約定日	6/9									

「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

<< 6/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,117,700	前日比	▲ 12,700
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%近辺での出合いが中心になると予想される。

**<< 9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、164兆7,000億円(当座預金残高見込みは213兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.075%、大手行からは0.069%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.075%となった。一巡後は調達レートが切り下がり、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。また、一部業態が試し取りと見られる調達を行った。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが散見される程度であった。

**<< 9日のオープン市場動向 >>**  
 現先S/N物は横ばい圏で推移した。短国市場は引き続き品薄感が強いなか、3M物・6M物の新発債で出合いが少々見られた程度で、総じて閑散なマーケットであった。CP市場は、ノンバンク業態からの大型発行案件がみられ、発行総額は1,100億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での取引となった。

**<< 10日の材料 >>**  
 \*佐藤日銀審議委員、山梨県金融経済懇談会にて講演  
 \*4月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲2.0%)  
 \*5月の企業物価指数  
 \*米国5月の財政収支

JGB新発10年債	0.450	▲ 0.040
日経平均株価(終値)	20,096.30	▲ 360.89
為替(9時)	124.57-58	
為替(5時)	124.53-55	

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	6/2	6/3	6/4	6/5	6/8	6/9
日銀当預残	2,091,000	2,090,500	2,094,500	2,107,500	2,107,500	2,130,400
準備預金残	1,915,600	1,912,700	1,909,500	1,929,300	1,924,500	1,943,500
レート	0.075%	0.074%	0.073%	0.075%	0.073%	0.074%
月中平均	0.07400%	0.07400%	0.07375%	0.07429%	0.07413%	0.07411%