

**<<資金需給>>**

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想	17日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		400	400	0
財政		78,300	4,800	1,000
資金過不足		78,700	5,200	1,000
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			10,000	
国庫短期証売却				
国債買入			11,600	
CP等買入				
		▲ 400	▲ 600	
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	1,100	
ETF買入		300		
国債補完供給	即日	▲ 400		
		200	400	
小計		▲ 400	22,500	0
当預増減		78,300	27,700	1,000

当座預金残高	2,198,500	6/15以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,013,200		0
積み終了先	1,691,500	6/16以降の残り所要積立額	
超過準備	1,691,500	積数	1,955,500
非準備先残高	185,300	1日平均	65,200
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)			2,026,700
6月の新所要見込			65,200 (一日平均)

6/12のマナタリーベース		3,059,900	
6/12コール	合計	200,196	無担 71,311 有担 128,885
コール前日増減	計	▲ 1,407	無担 1,488 有担 ▲ 2,895

6/15の加重平均レート(速報)				6/12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	単位(%)	
0.050 ~0.125 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)					O/N	0.030 ~0.080 (0.074)
0.072 ~0.120 (0.076)						T/N	
						S/N	0.072 ~0.120 (0.080)
						1W	0.116 ~0.117 (0.117)
0.118 (0.118)						2W	0.115 ~0.118 (0.116)
						3W	
		0.08-0.13	-			1M	0.145 (0.145)
		0.08-0.12	-			2M	
		0.08-0.12	0.00-0.001			3M	
		-	-			6M	
		-	-			1Y	

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完 14,569億円 6/15 ~ 6/16 (1日間) 応札 425億円 落札 425億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)

「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

<< 6/16の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,226,200	前日比	27,700
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%台での出合いが中心になると予想される。

<< 15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、169兆6,000億円(当座預金残高見込みは、過去最高の220兆円)。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%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.073~0.075%と先週末よりもやや弱めの立ち上がりとなった。一巡後は調達レートが低下し、0.07%近辺での出合いが散見されつつ、今積み期の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<< 15日のオープン市場動向 >>  
現先取引S/Nは横ばい圏で推移。短国市場は3M物で0.00%近辺での出合いが見られたものの、動意に乏しく終日閑散であった。CP発行市場は少額の出合いが数件みられた程度で、発行総額は100億円に満たなかった。既に購入意欲は減退しており、少額の発行量ながらレート水準に特段の変化は見られなかった。

<< 16日の材料 >>  
\*米国FOMC(1日目)  
\*米国5月の住宅着工件数  
\*英国5月の消費者物価指数  
\*5年利付国債入札(25,000億円、6/22発行)

<<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	0.07294%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07300%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.500	0.000	日経平均株価(終値)	20,387.79	▲ 19.29	為替(9時)	123.29-31
						為替(5時)	123.51-53

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	6/8	6/9	6/10	6/11	6/12	6/15
日銀当預残	2,107,500	2,130,400	2,117,800	2,117,200	2,120,200	2,198,500
準備預金残	1,924,500	1,943,500	1,921,800	1,930,900	1,943,300	2,013,200
レート	0.073%	0.074%	0.089%	0.074%	0.074%	0.073%
月中平均	0.07413%	0.07411%	0.07560%	0.07545%	0.07514%	0.07500%