

<<資金需給>>

単位 億円

	16日需給速報		17日需給予想	18日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	▲ 800	▲ 1,000
財政		5,900	1,300	0
資金過不足		6,100	500	▲ 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				
		▲ 600	▲ 200	
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		1,100		
ETF買入			200	
国債補完供給	即日	▲ 200		
		400	200	
小計		22,300	200	0
当預増減		28,400	700	▲ 1,000

6/17の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,227,600	前日比	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。

<< 16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、171兆5,000億円(当座預金残高見込みは、過去最高の222兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.075%、大手行からは0.065%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.073~0.075%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、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<< 16日のオープン市場動向 >>
 現先取引S/Nは概ね落ち着いた水準で推移した。短国市場は17日と18日の入札を控えて動意に乏しく、3M物0.001~0.002%の出合いが見られた程度であった。CP発行市場は複数のリース・ノンバンクよりまとまった発行が見られ、発行総額は2,900億円程度に上った。レート水準は、6月償還物を中心に0.10%近辺となっていた。

<< 17日の材料 >>
 *5月の貿易統計
 *米国FOMC(2日目)
 *米国FRB経済見通し発表
 *ユーロ圏5月の消費者物価指数改定値
 *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、6/22発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、6/25借入)

◀◀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%

当座預金残高	2,226,900	6/16以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,031,600		1,955,500
積み終了先	574,300	6/17以降の残り所要積立額	
超過準備	440,300	積数	686,200
非準備先残高	195,300	1日平均	23,700
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)			1,955,500
準備預金進捗率	64.91% (実績)		3.33% (日数)

JGB新発10年債	0.495	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	20,257.94	▲ 129.85	為替(9時)	123.42-43
						為替(5時)	123.48-50

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	6/9	6/10	6/11	6/12	6/15	6/16
日銀当預残	2,130,400	2,117,800	2,117,200	2,120,200	2,198,500	2,226,900
準備預金残	1,943,500	1,921,800	1,930,900	1,943,300	2,013,200	2,031,600
レート	0.074%	0.089%	0.074%	0.074%	0.073%	0.073%
月中平均	0.07411%	0.07560%	0.07545%	0.07514%	0.07500%	0.07488%

6/15のマナタリーベース				3,137,800		
6/15コール	合計	203,888	無担	72,534	有担	131,354
コール前日増減	計	3,692	無担	1,223	有担	2,469

6/16の加重平均レート(速報)				6/15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		有担当日分
0.055 ~0.125 (0.073)	0.030	~0.040	(0.031)			O/N	0.050 ~0.125 (0.073)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.072 ~0.120 (0.075)						T/N		0.072 ~0.120 (0.076)
						S/N		
0.092 ~0.340 (0.131)						1W		
0.180 (0.180)						2W	0.118	(0.118)
						3W		
				0.08-0.13	-	1M		
				0.08-0.12	-	2M		
				0.08-0.12	0.001-0.002	3M		
				-	-	6M		
				-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 6,639億円 6/16 ~ 6/17 (1日間) 応札 186億円 落札 186億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 CP買入 3,500億円 6/19 応札 9,308億円 落札 3,495億円 按分レート 0.087% 40.8% 平均落札レート 0.093%
 米ドル資金供給(固定金利方式) 6/18~6/25 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.640%
 5年利付国債(表面利率0.1%) 応札6兆6,015億円 落札2兆2,979億円(I非競争入札:2,002億円) 6/22~2020/6/20 0.124% 按分72.5100% 平均0.122%
 ETF買入 370億円 約定日 6/16

「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