

◀資金需給▶

単位 億円

| | 27日需給速報 | | 30日需給予想 | 1日当社予想 |
|---------------------------------------|---------|---------|----------|--------|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | ▲ 2,500 | 100 | 1,000 |
| 財政 | | 4,700 | ▲ 14,100 | 0 |
| 資金過不足 | | 2,200 | ▲ 14,000 | 1,000 |
| 貸出 | | | | |
| 売出手形 | | | | |
| 0 | | | | |
| 本店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 全店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 共通(固定) | | | 1,600 | |
| 118,159 | | | ▲ 1,000 | |
| 国債買現 | | | | |
| 0 | | | | |
| CP買現 | | | | |
| 0 | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | 15,000 |
| 国庫短期証売却 | | | | |
| 国債買入 | | 9,100 | | 6,300 |
| CP等買入 | | | 4,300 | |
| | | ▲ 900 | ▲ 6,900 | |
| 貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488 | | | | |
| 被災地支援 | | 500 | | |
| 3,785 | | ▲ 500 | | |
| 社債等買入 | | | ▲ 100 | |
| ETF買入 | | | | |
| 国債補完供給 | | | | |
| 小計 | | 8,200 | ▲ 2,100 | 21,300 |
| 当預増減 | | 10,400 | ▲ 16,100 | 22,300 |

| | | | |
|---------------------------|-------------|----------------|--------|
| 当座預金残高 | 1,538,900 | 6/27以降の残り所要積立額 | 38,700 |
| 準備預金残高 | 1,405,800 | 6/30以降の残り所要積立額 | 24,600 |
| 積み終了先 | 1,173,500 | 積数 | 1,500 |
| 超過準備 | 1,171,900 | 1日平均 | 1,500 |
| 非準備先残高 | 133,100 | | |
| 積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数) | 1,841,700 | | |
| 準備預金進捗率 | 98.66% (実績) | 46.67% (日数) | |

| | | | |
|---------------|----|-----------|---------------------|
| 6/26のマネタリーベース | | 2,437,300 | |
| 6/26コール | 合計 | 164,224 | 無担 67,941 有担 96,283 |
| コール前日増減 | 計 | ▲ 2,847 | 無担 ▲ 2,299 有担 ▲ 548 |

| 6/27の加重平均レート(速報) | | | 6/26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 |
| 0.050 ~0.135 (0.066) | 0.040 ~0.050 (0.041) | | | O/N 0.050 ~0.135 (0.066) | | 0.040 ~0.050 (0.041) |
| 0.050 ~0.122 (0.055) | | | | T/N | 0.063 ~0.120 (0.072) | |
| | | | | S/N | | |
| | | | | 1W | | |
| 0.118 (0.118) | | | | 2W | 0.116 (0.116) | |
| 0.115 (0.115) | | | | 3W | | |
| 0.118 ~0.145 (0.124) | | 0.08-0.12 | - | 1M | 0.090 ~0.118 (0.117) | 有担先日付分 |
| | | 0.08-0.12 | - | 2M | | |
| | | 0.08-0.12 | 0.022-0.03 | 3M | | |
| | | - | - | 6M | | |
| | | - | 0.023-0.029 | 1Y | | |

◀オペ情報、入札結果▶

| | | | | | | | | | | | |
|------|----------|-----|----|----------|----|----------|---------|---------|-------|---------|---------|
| 国短買入 | 15,000億円 | 7/1 | 応札 | 38,798億円 | 落札 | 15,005億円 | 按分利回り較差 | -0.001% | 50.5% | 平均利回り較差 | 0.000% |
| 国債買入 | 3,000億円 | 7/1 | 応札 | 5,743億円 | 落札 | 3,003億円 | 按分利回り較差 | -0.003% | 98.7% | 平均利回り較差 | -0.003% |
| 国債買入 | 2,000億円 | 7/1 | 応札 | 6,539億円 | 落札 | 2,003億円 | 按分利回り較差 | 0.000% | 4.8% | 平均利回り較差 | 0.001% |
| 国債買入 | 1,000億円 | 7/1 | 応札 | 2,735億円 | 落札 | 1,003億円 | 按分利回り較差 | 0.000% | 20.2% | 平均利回り較差 | 0.003% |
| 国債買入 | 300億円 | 7/1 | 応札 | 945億円 | 落札 | 301億円 | 按分利回り較差 | -0.010% | 81.4% | 平均利回り較差 | -0.008% |

ETF買入 130億円 約定日 6/27

| ◀ 6/30の日銀調節とレート予想 ▶ | | | | | |
|---------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 1,522,800 | 前日比 | ▲ 16,100 |
| O/N | 0.06~0.07 | T/N | 0.06~0.12 | S/N | 0.06~0.12 |

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心となろう。

◀ 27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9,000億円増加の116兆9,000億円(当座預金残高見込みは154兆円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.06%近辺、信託・証券業態から0.065%近辺の調達希望ではじまった。立ち上がりは0.06~0.065%近辺を中心とした出合いとなった。調達意欲は弱かったものの、一巡後も散発的にビッドが入る場面があり、レートを落とさず推移した。ターム物では、1W~1M物の期間で大手行による調達が見られた。

◀ 27日のオープン市場動向 ▶
 短国市場では、短国買入オペが前回比5,000億円減となる15,000億円で購入され、按分利回り較差▲0.001%、平均落札利回り較差±0%の結果となった。買入オペ以外では売却が難しいレート水準であることから、確実に売却したいニーズが反映されたものと思われる。オペ後は調整売りから小甘しい展開となった。CP市場は、償還総額600億円程度に対し、石油・鉄鋼業態からの大型発行が見られたことで、発行総額は3,000億円強となった。発行レートは横ばい圏での動きとなった。

- ◀ 30日の材料 ▶
- *5月の鉱工業生産・出荷・在庫速報
 - *5月の住宅着工統計
 - *米国6月のシカゴPM景況感指数
 - *ユーロ圏6月の消費者物価指数速報値

| | | | | | | | |
|-----------|-------|---------|------------|-----------|----------|--------|-----------|
| JGB新発10年債 | 0.560 | ▲ 0.005 | 日経平均株価(終値) | 15,095.00 | ▲ 213.49 | 為替(9時) | 101.63-65 |
| | | | | | | 為替(5時) | 101.42-43 |

| 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 | 6/20 | 6/23 | 6/24 | 6/25 | 6/26 | 6/27 |
| 日銀当預残 | 1,513,900 | 1,507,800 | 1,528,700 | 1,534,900 | 1,528,500 | 1,538,900 |
| 準備預金残 | 1,365,600 | 1,363,600 | 1,387,500 | 1,390,900 | 1,389,400 | 1,405,800 |
| レート | 0.066% | 0.065% | 0.066% | 0.069% | 0.066% | 0.066% |
| 月中平均 | 0.06795% | 0.06783% | 0.06775% | 0.06780% | 0.06773% | 0.06767% |

「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