

《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		400	300	0
財政		▲ 2,000	▲ 27,400	1,000
資金過不足		▲ 1,600	▲ 27,100	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
118,759				
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		6,400		9,000
CP等買入		▲ 100	▲ 100	
貸出支援基金(成長)				
34,837(増加) 133,488				
被災地支援				
3,785				
社債等買入				
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		21,400	0	9,000
当預増減		19,800	▲ 27,100	10,000
当座預金残高	1,543,000	7/1以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,405,900	21,100		
積み終了先	1,179,400	7/2以降の残り所要積立額		
超過準備	1,179,400	積数		
非準備先残高	137,100	1日平均		
		1,300		
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,841,300			
準備預金進捗率	99.02% (実績)	53.33% (日数)		

6/30のマネタリーベース		2,434,300	
6/30コール	合計	161,538	無担 55,868 有担 105,670
コール前日増減	計	▲ 192	無担 ▲ 8,640 有担 8,448

7/1 の加重平均レート(速報)				6/30 の加重平均レート(確報)				単位 (%)
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分
0.055 ~0.135 (0.065)	0.040	~0.050 (0.041)		O/N	0.040 ~0.080 (0.058)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.060 ~0.122 (0.064)				T/N		0.063 ~0.122 (0.069)		
				S/N				
0.073 ~0.200 (0.119)				1W		0.087 ~0.400 (0.134)		
0.118 ~0.330 (0.145)				2W		0.140 (0.140)		
				3W		0.145 (0.145)		
0.118 ~0.270 (0.134)				1M		0.118 ~0.160 (0.132)		有担先日付分
				2M				
				3M				
				6M				
				1Y				

《オペ情報、入札結果》

国債買入	3,000億円	7/3	応札	12,486億円	落札	3,006億円	按分利回り較差	-0.002%	27.7%	平均利回り較差	-0.001%
国債買入	2,000億円	7/3	応札	8,224億円	落札	2,007億円	按分利回り較差	0.001%	27.5%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	7/3	応札	11,951億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.005%	35.8%	平均利回り較差	-0.004%
米ドル資金供給(固定金利方式)		7/3~7/10 (7日間)	応札なし				貸付利率	0.600%			

「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。」

7/2の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,515,900	前日比	▲ 27,100
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。

《 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、前日比1兆3000億円増の118兆2,000億円(当座預金残高見込みは154兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、四半期末要因が剥落した事で通常取引に戻り、地銀・信託・証券業態から0.06~0.065%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。一巡後は、0.06%近辺で散発的に出合う程度で本日の取引を終えた。ターム物は、証券業態の調達が数件見られた。

《 1日のオープン市場動向 》
 現先レートS/Nは、概ね同水準で推移した。短国市場は、店頭売りにより1M:0.036~0.045%、2M:0.035~0.045%、3M:0.03~0.04%と小甘い展開であった。CP市場は、四半期末に残高を落とした鉄鋼・電機業態を中心にまとまった発行が複数実施され、発行総額は1,800億円にまで膨らんだ。発行レートは横ばい圏であった。

《 2日の材料 》
 *6月のマネタリーベース
 *7月の日銀当座預金増減要因見込み
 *米国5月の製造業新規受注・出荷・在庫

《コール6月の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	0.06723%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06705%	有担 0.04100%

JGB新発10年債	0.550	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	15,326.20	164.10	為替(9時)	101.30-32
						為替(5時)	101.51-52

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	6/24	6/25	6/26	6/27	6/30	7/1
日銀当預残	1,528,700	1,534,900	1,528,500	1,538,900	1,523,200	1,543,000
準備預金残	1,387,500	1,390,900	1,389,400	1,405,800	1,394,000	1,405,900
レート	0.066%	0.069%	0.066%	0.066%	0.058%	0.065%
月中平均	0.06775%	0.06780%	0.06773%	0.06755%	0.06723%	0.06500%

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