

<<資金需給>>

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想		7日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 200	▲ 400	▲ 1,000		
財政		2,300	4,800	▲ 28,000		
資金過不足		2,100	4,400	▲ 27,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					2,700	
118,759					▲ 3,700	
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						
国庫短期証売却						
国債買入		9,200				
CP等買入						
		▲ 200	▲ 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						
国債補完供給		100				
小計		9,100	▲ 100	▲ 1,000		
当預増減		11,200	4,300	▲ 28,000		

当座預金残高	1,527,500	7/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,390,300		15,600
積み終了先	1,167,500	7/4以降の残り所要積立額	
超過準備	1,167,400	積数	13,200
非準預先残高	137,200	1日平均	1,100
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	99.28% (実績)	60.00% (日数)	

7/2のマネタリーベース				2,426,600
7/2コール	合計	153,945	無担	56,122
			有担	97,823
コール前日増減	計	1,137	無担	1,554
			有担	▲ 417

7/3の加重平均レート(速報)				7/2の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分	
0.040 ~0.135 (0.065)	0.040	~0.050 (0.041)		0.050 ~0.135 (0.065)			有担当日分
0.063 ~0.065 (0.064)					0.063 ~0.065 (0.064)		
0.081 ~0.340 (0.088)					0.117 ~0.130 (0.124)		
					0.118 ~0.330 (0.153)		
		0.08-0.12	0.0400				有担先日付分
		0.08-0.12	0.035~0.0525				
		0.08-0.12	0.025~0.052				
		-	-				
		-	-				

<< 7/4の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,531,800	前日比	4,300
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。

<< 3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116兆9,000億円(当座預金残高見込みは152兆8,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.06~0.064%での調達、大手行からは0.06%での調達希望と、昨日とほぼ同水準の始まりとなった。出合い一巡後は0.06%の取引も散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件が数件見られた。

<< 3日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、やや高めめの推移となった。短国市場は、新発3M物の入札が行われた。全体的に軟調な展開が続いていたものの、最高落札利回り0.0461%、按分率74.1672%、平均落札利回り0.0457%、事前予想よりやや強めの結果となった。セカンダリーでは、ショートカバーから一時0.025%まで買い進まれる動きも見られた。本日の出合いは、1M:0.040%、2M:0.035~0.0525%、3M:0.025~0.052%とワイドレンジとなった。CP市場は、鉄鋼・電機・石油業態からまとまった発行が実施され、発行総額は2,000億円程度となった。発行レートの目線は概ね横ばいながらも、一部で若干上昇する銘柄も見られた。

<< 4日の材料 >>
 *米国休場(独立記念日)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、7/17発行)

<<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	0.565	0.005	日経平均株価(終値)	15,348.29	▲ 21.68	為替(9時)	101.83-84
						為替(5時)	101.92-93

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	6/26	6/27	6/30	7/1	7/2	7/3
日銀当預残	1,528,500	1,538,900	1,523,200	1,543,000	1,516,300	1,527,500
準備預金残	1,389,400	1,405,800	1,394,000	1,405,900	1,377,300	1,390,300
レート	0.066%	0.066%	0.058%	0.065%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06773%	0.06755%	0.06723%	0.06500%	0.06500%	0.06500%

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 7/7 ~ 10/6 (91日間) 応札 2,670億円 落札 2,670億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札28兆8,314億円 落札5兆2,320億3,000万円(非競争入札:4,679億円) 7/7~10/6 0.0461% 按分74.1672% 平均0.0457%
 10年利付国債(表面利率0.6%) 応札 7兆5,584億円 落札 2兆2,029億円(I非競争入札:1,919億円) 7/7~2024/6/20 0.563% 按分98.9415% 平均0.562%

「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