

**<<資金需給>>**

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,100	1,000	0
財政		▲ 29,400	▲ 1,800	▲ 2,000
資金過不足		▲ 28,300	▲ 800	▲ 2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,700		
117,699		▲ 3,700		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			20,000	
国庫短期証売却				
国債買入			5,300	6,300
CP等買入				4,000
		▲ 500	▲ 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	
国債補完供給		200		
小計		▲ 1,300	25,300	10,300
当預増減		▲ 29,600	24,500	8,300
当座預金残高	1,502,100	7/7以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,365,500		7,400	
積み終了先	1,146,800	7/8以降の残り所要積立額		
超過準備	1,146,800		積数	7,200
非準備先残高	136,600		1日平均	900
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,852,500			
準備預金進捗率	99.61% (実績)	73.33%	(日数)	

<< 7/8の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,526,600	前日比	24,500
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。

<< 7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、前営業日比2兆8,000億円減の115兆円(当座預金残高見込みは150兆3,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.063~0.065%、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。週末要因が剥落したことで、落ち着いた展開が続き、そのまま本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いはみられなかった。

<< 7日のオープン市場動向 >>  
 現先S/N物は弱含み横ばい圏で推移となった。短国市場は、品薄感から閑散とした地合いとなり、1M0.030~0.040%で小額の出合いが見られた程度であった。CP市場は償還総額200億円程度に対し、一部、電機・ノンバンク業態からまとまった発行案件が見られたことで、発行総額は700億円程度まで膨らんだものの、全体的には閑散とした取引となった。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなっていた。

<< 8日の材料 >>  
 \*5月の国際収支 \*6月の景気ウォッチャー調査  
 \*中曾日銀副総裁、ACCJ・EBC・SCCIJ共催Joint Luncheonにて公演  
 \*米国5月の消費者信用残高  
 \*国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、7/10発行)  
 \*10年物価連動国債入札(4,000億円、7/10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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	102.11-12
0.560 ▲ 0.005	15,379.44 ▲ 57.69	為替(5時)	102.04-06

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	6/30	7/1	7/2	7/3	7/4	7/7
日銀当預残	1,523,200	1,543,000	1,516,300	1,527,500	1,531,700	1,502,100
準備預金残	1,394,000	1,405,900	1,377,300	1,390,300	1,400,200	1,365,500
レート	0.058%	0.065%	0.065%	0.065%	0.066%	0.065%
月中平均	0.06723%	0.06500%	0.06500%	0.06500%	0.06550%	0.06543%

7/4のマネタリーベース				2,442,500
7/4コール	合計	148,437	無担	51,071
有担				97,366
コール前日増減	計	▲ 2,241	無担	▲ 2,405
有担				164

7/7の加重平均レート(速報)				7/4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		
0.060 ~0.135 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.050 ~0.135 (0.066)				
0.063 ~0.120 (0.065)				T/N	0.063 ~0.125 (0.094)			
				S/N	0.125 (0.125)			
0.150 ~0.400 (0.196)				1W 0.065 (0.065)				
				2W 0.170 (0.170)				
				3W				
0.270 (0.270)		0.08-0.12	0.030-0.040	1M			有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	-	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	3,000億円	7/9	応札	10,060億円	落札	3,010億円	按分利回り較差	0.003%	22.9%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	2,000億円	7/9	応札	8,381億円	落札	2,001億円	按分利回り較差	0.000%	30.0%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	1,000億円	7/9	応札	5,024億円	落札	1,010億円	按分利回り較差	0.004%	16.7%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	300億円	7/9	応札	1,862億円	落札	300億円	全取利回り較差	0.005%		平均利回り較差	0.006%

「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