

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想	14日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 700	0	1,000
財政		▲ 8,400	600	▲ 33,000
資金過不足		▲ 9,100	600	▲ 32,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,800
117,699				▲ 5,800
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			5,200	
CP等買入				
		▲ 500	▲ 200	
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		200		
小計		▲ 200	5,100	▲ 3,000
当預増減		▲ 9,300	5,700	▲ 35,000

当座預金残高	1,529,200	7/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,388,200		5,100
積み終了先	1,169,900	7/11以降の残り所要積立額	
超過準備	1,169,900	積数	4,300
非準備先残高	141,000	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	99.77% (実績)	83.33% (日数)	

7/9のマネタリーベース				2,446,500		
7/9コール	合計	150,400	無担	55,623	有担	94,777
コール前日増減	計	▲ 246	無担	416	有担	▲ 662

7/10の加重平均レート(速報)			7/9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
0.030 ~0.135 (0.064)	0.030 ~0.050 (0.033)			0.050 ~0.150 (0.066)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.065 ~0.120 (0.078)					0.062 ~0.120 (0.067)	
					0.073 ~0.130 (0.087)	
0.340 (0.340)					0.270 (0.270)	
0.150 (0.150)		0.08-0.12	0.0200		0.260 (0.260)	有担先日付分
		0.08-0.12	0.0200			
		0.08-0.12	▲0.002-0.029			
0.300 (0.300)		-	0.0100			
		-	-			

<< 7/11の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,534,900	前日比	5,700
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。

<< 10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1兆2,000億円減の117兆5,000億円(当座預金残高見込みは153兆円)。無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.06~0.063%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。一部で0.065%前後の出合いも見られたが、その後は0.06%で散発的に出合うなか、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いが見られなかった。

<< 10日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばい圏で推移した。短国市場は3M物の入札が実施された。品薄感が強い中、WI取引でマイナスでの取引が見られるなど、過熱感の強い入札が予想されたが、落札結果は平均落札利回0.0182%、按分落札利回0.0317%と、水準への警戒感もあつてか、平均と按分が大幅に乖離する結果となった。セカンダリー市場では0.025~0.029%での出合いが見られた。CP市場は、償還総額500億円程度に対し、鉄鋼業態から大型の案件が見られたことで、発行総額は1,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での取引となった。

<< 11日の材料 >>
 *5月のマネタリーサーベイ
 *米国6月の財政収支

JGB新発10年債	0.545	0.000	日経平均株価(終値)	15,216.47	▲ 86.18	為替(9時)	101.53-54
						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	7/3	7/4	7/7	7/8	7/9	7/10
日銀当預残	1,527,500	1,531,700	1,502,100	1,529,500	1,538,500	1,529,200
準備預金残	1,390,300	1,400,200	1,365,500	1,392,100	1,398,100	1,388,200
レート	0.065%	0.066%	0.065%	0.066%	0.066%	0.064%
月中平均	0.06500%	0.06550%	0.06543%	0.06550%	0.06556%	0.06540%

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 7/14 ~ 10/14 (92日間) 応札 2,761億円 落札 2,761億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 社債買入 1,000億円 7/16 応札 1,924億円 落札 1,001億円 按分レート 0.111% 15.2% 平均落札レート 0.120%
 T-Bill3M 応札25兆4,475億円 落札5兆2,046億7,000万円(非競争入札:4,753億円) 7/14~10/14 0.0317% 按分18.4767% 平均0.0182%
 30年利付国債(表面利率1.7%) 応札2兆139億円 落札6,459億円(I非競争入札:532億円) 7/14~2014/6/20 1.710% 按分38.9434% 平均1.703%
 ETF買入 144億円 約定日 7/10

「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