

<<資金需給>>

単位 億円

	11日需給速報		14日需給予想	15日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	1,400	1,000
財政		1,400	▲ 37,200	▲ 3,000
資金過不足		1,600	▲ 35,800	▲ 2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			2,800	
117,699			▲ 5,800	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				30,000
国庫短期証売却				
国債買入		5,200		6,300
CP等買入		▲ 200	▲ 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	
国債補充供給				
小計		5,100	▲ 3,100	36,300
当預増減		6,700	▲ 38,900	34,300

7/14の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,497,000	前日比	▲ 38,900
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.06%台前半での出合いが中心となろう。

<< 11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3,000億円増の117兆8,000億円(当座預金残高見込みは153兆5,000億円)。本日の無担O/Nは、大手行・地銀・信託・証券業態から0.065%での調達で始まった。週末要因により、昨日までと比べ調達ニーズが強く、出合い巡後も底堅く推移しつつ、本日の取引を終えた。タム物は、証券業態の調達となるロール案件が見られた程度であった。

<< 11日のオープン市場動向 >>

現先S/N物は横ばい圏での推移となった。短国市場は、短国買入オペが前週比1兆円増加の3兆円で行われた。売却ニーズが強かったことから、平均利回較差+0.001%、按分利回較差▲0.002%と市場実勢での結果となった。CP市場は、五・十日に係る発行となり、石油・ノンバンク業態等からまとまった発行案件が見られ、発行総額は2,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなっていた。

<< 14日の材料 >>

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、15日まで)
*5月の石油等消費動向統計

当座預金残高	1,535,900	7/11以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,400,800		4,300
積み終了先	1,182,700	7/14以降の残り所要積立額	
超過準備	1,182,700	積数	1,100
非準備先残高	135,100	1日平均	500
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	99.94%	(実績)	93.33% (日数)

JGB新発10年債	0.535	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	15,164.04	▲ 52.43	為替(9時)	101.30-32
						為替(5時)	101.36-37

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	7/4	7/7	7/8	7/9	7/10	7/11
日銀当預残	1,531,700	1,502,100	1,529,500	1,538,500	1,529,200	1,535,900
準備預金残	1,400,200	1,365,500	1,392,100	1,398,100	1,388,200	1,400,800
レート	0.066%	0.065%	0.066%	0.066%	0.064%	0.065%
月中平均	0.06550%	0.06543%	0.06550%	0.06556%	0.06540%	0.06531%

7/10のマネタリーベース				2,437,800		
7/10コール	合計	149,727	無担	54,131	有担	95,596
コール前日増減	計	▲ 673	無担	▲ 1,492	有担	819

7/11の加重平均レート(速報)				7/10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		有担当日分	
0.030 ~0.135 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)					0.030 ~0.135 (0.064)		0.030 ~0.050 (0.033)	
0.065 ~0.120 (0.073)							0.065 ~0.120 (0.078)		
0.075 ~0.290 (0.086)									
							0.170 ~0.340 (0.198)		
0.075 ~0.148 (0.098)				0.08-0.12	-		0.150 (0.150)		有担先日付分
				0.08-0.12	-				
				0.08-0.12	0.022-0.025				
				-	-		0.300 (0.300)		
				-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補充	1,395億円	7/11	~ 7/14 (3日間)	応札	2億円	落札	2億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	30,000億円	7/15	応札	55,041億円	落札	30,003億円	按分利回り較差	-0.002%	51.2%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	3,000億円	7/15	応札	8,023億円	落札	3,004億円	按分利回り較差	0.002%	31.9%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	2,000億円	7/15	応札	8,390億円	落札	2,001億円	按分利回り較差	0.004%	75.7%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	1,000億円	7/15	応札	3,758億円	落札	1,008億円	按分利回り較差	-0.002%	11.4%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	300億円	7/15	応札	1,636億円	落札	303億円	按分利回り較差	0.008%	93.4%	平均利回り較差	0.008%

交付税特会 1兆500億円 7/24~2015/1/22 応札 3兆2,450億円 落札1兆500億円 0.100% 按分 34.0427% 平均 0.098%

ETF買入 144億円 約定日 7/11

J-REIT買入 5億円 約定日 7/11

「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