

<<資金需給>>

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想	1日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	100	1,000
財政		▲ 500	1,400	▲ 3,000
資金過不足		▲ 1,400	1,500	▲ 2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			700	
68,058			▲ 7,600	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			10,000	
国庫短期証売却				
国債買入			11,900	5,400
CP等買入			4,000	
		▲ 400	▲ 4,800	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援				
3,241				
社債等買入				
ETF買入		100	200	
国債補充供給	即日	▲ 200	200	
小計		▲ 500	14,600	5,400
当預増減		▲ 1,900	16,100	3,400

6/30の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,299,300	前日比	16,100
O/N	0.01~0.06	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.01~0.06%程度での出合いが中心になると予想される。

<< 29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、173兆円(当座預金残高見込みは、228兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.075%、大手行からは0.07%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.07~0.075%となった。一巡後は調達レートが低下し、0.07%近辺での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件中心の取引となった。

<< 29日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは低位で推移した。短国市場は、3M物が▲0.005%で出合いが見られたものの、閑散小動きであった。CP市場は、石油業態からの大型発行案件がみられたことや、期末を越えて発行再開となった銘柄もみられたことで、発行総額は4,000億円弱に膨らんだ。発行レートは、横ばいから小幅上昇して決着する銘柄が目立っていた。

<< 30日の材料 >>

- *5月の毎月勤労統計調査速報
- *米国4月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- *米国6月のCB消費者信頼感指数
- *米国6月のシカゴPM景況感指数
- *英国1-3月期のGDP確報値
- *ユーロ圏6月の消費者物価指数速報値

当座預金残高	2,283,200	6/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,077,100		3,000
積み終了先	1,730,600	6/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,730,600	積数	2,700
非準備先残高	206,100	1日平均	200
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,955,800		
準備預金進捗率	99.86% (実績)	46.67% (日数)	

JGB新発10年債	0.435	▲ 0.035	日経平均株価(終値)	20,109.95	▲ 596.20	為替(9時)	122.58-60
						為替(5時)	122.91-93

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	6/22	6/23	6/24	6/25	6/26	6/29
日銀当預残	2,258,500	2,259,300	2,276,500	2,272,100	2,285,100	2,283,200
準備預金残	2,065,500	2,063,500	2,073,300	2,065,700	2,078,600	2,077,100
レート	0.073%	0.074%	0.077%	0.073%	0.073%	0.072%
月中平均	0.07468%	0.07465%	0.07475%	0.07468%	0.07450%	0.07441%

6/26のマナターベース				3,236,200		
6/26コール	合計	196,605	無担	67,679	有担	128,926
コール前日増減	計	▲ 1,605	無担	▲ 1,072	有担	▲ 533

6/29の加重平均レート(速報)				6/26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	O/N	無担当日分	無担先日付分	有担当日分		
0.055 ~0.125 (0.072)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.030 ~0.125 (0.073)				0.030 ~0.040 (0.031)	
0.005 ~0.128 (0.016)				T/N		0.068 ~0.120 (0.078)			
				S/N		0.005 ~0.010 (0.008)			
				1W	0.180 (0.180)	0.081 (0.081)			
0.118 (0.118)				2W		0.145 (0.145)			
				3W					
0.175 ~0.180 (0.178)		0.08-0.13	-	1M					有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M					
		0.08-0.12	▲0.005	3M		0.200 (0.200)			
		-	-	6M					
		-	-	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	5,538億円	6/29	~ 6/30 (1日間)	応札	214億円	落札	214億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国債買入	4,000億円	7/1		応札	16,003億円	落札	4,000億円	-0.024%		平均利回り較差	-0.022%
国債買入	1,400億円	7/1		応札	4,034億円	落札	1,402億円	-0.32円	65.5%	平均価格較差	-0.412円
ETF買入	370億円	約定日	6/29								
J-REIT買入	13億円	約定日	6/29								

「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