

<<資金需給>>

単位 億円

| | 30日需給速報 | | 1日需給予想 | 2日当社予想 |
|---------------|---------|---------|---------|----------|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | 0 | ▲ 500 | 0 |
| 財政 | | 1,400 | ▲ 6,100 | ▲ 25,000 |
| 資金過不足 | | 1,400 | ▲ 6,600 | ▲ 25,000 |
| 貸出 | | | | |
| 売出手形 | | 0 | | |
| 本店共通 | | 0 | | |
| 全店共通 | | 0 | | |
| 共通(固定) | | 700 | | |
| 61,199 | | ▲ 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 | 5,600 | |
| CP等買入 | | 4,000 | | |
| | | ▲ 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 | | 200 | 100 | |
| 国債補完供給 | 即日 | ▲ 800 | 800 | |
| | | 200 | | |
| 小計 | | 13,800 | 6,500 | 0 |
| 当預増減 | | 15,200 | ▲ 100 | ▲ 25,000 |

| << 7/1の日銀調節とレート予想 >> | | | | | |
|----------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 2,298,300 | 前日比 | ▲ 100 |
| O/N | 0.05~0.07 | T/N | 0.06~0.12 | S/N | 0.06~0.12 |

無担O/Nは0.05~0.07%程度での出合いが中心になると予想される。

<< 30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、174兆9,000億円(当座預金残高見込みは、過去最高の229兆9,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.001~0.005%、大手行からは0.001~0.003%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.001~0.005%となった。一巡後も同様の水準で散発的に出合った程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<< 30日のオープン市場動向 >>
 現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、様子見姿勢が強く、閑散とした地合いが続いていた。CP市場は、発行・償還ともに500~600億円程度の規模であった。発行レートは概ね横ばい圏での決着となった。

<< 1日の材料 >>
 *6月調査の日銀短観(概要及び要旨)
 市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+12
 *6月実績/7月見込み財政資金対民間収支
 *米国5月の建設支出
 *米国6月のISM製造業景況指数

| <<コール6月の加重平均レート>> | | | |
|-------------------|----|----------|-------------|
| (土日を含む) | 無担 | 0.07230% | 有担 0.03100% |
| (営業日のみ) | 無担 | 0.07168% | 有担 0.03100% |

| | | | |
|---------|-------------|---------------------------|-------------|
| 当座預金残高 | 2,298,400 | 6/30以降の残り所要積立額 | 2,700 |
| 準備預金残高 | 2,086,100 | 7/1以降の残り所要積立額 | 2,300 |
| 積み終了先 | 1,742,600 | 積数 | 2,300 |
| 超過準備 | 1,742,600 | 1日平均 | 200 |
| 非準備先残高 | 212,300 | 積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数) | 1,953,900 |
| 準備預金進捗率 | 99.88% (実績) | | 50.00% (日数) |

| | | | | | | | |
|-----------|-------|-------|------------|-----------|--------|--------|-----------|
| JGB新発10年債 | 0.450 | 0.015 | 日経平均株価(終値) | 20,235.73 | 125.78 | 為替(9時) | 122.65-67 |
| | | | | | | 為替(5時) | 122.24-26 |

| 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 | 6/23 | 6/24 | 6/25 | 6/26 | 6/29 | 6/30 |
| 日銀当預残 | 2,259,300 | 2,276,500 | 2,272,100 | 2,285,100 | 2,283,200 | 2,298,400 |
| 準備預金残 | 2,063,500 | 2,073,300 | 2,065,700 | 2,078,600 | 2,077,100 | 2,086,100 |
| レート | 0.074% | 0.077% | 0.073% | 0.073% | 0.072% | 0.071% |
| 月中平均 | 0.07465% | 0.07475% | 0.07468% | 0.07450% | 0.07441% | 0.07230% |

| 6/29のマナターベース | | 3,235,300 | |
|--------------|----|-----------|----------------------|
| 6/29コール | 合計 | 190,399 | 無担 56,932 有担 133,467 |
| コール前日増減 | 計 | ▲ 6,206 | 無担 ▲ 10,747 有担 4,541 |

| 6/30の加重平均レート(速報) | | | | 6/29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 | 有担先日付分 | |
| 0.001 ~0.125 (0.011) | 0.030 ~0.040 (0.031) | | | 0.055 ~0.125 (0.072) | 0.005 ~0.128 (0.016) | 0.030 ~0.040 (0.031) | | |
| 0.040 ~0.120 (0.057) | | | | | | | | |
| 0.062 ~0.200 (0.073) | | | | | | | | |
| 0.118 ~0.175 (0.121) | | | | | 0.118 (0.118) | | | |
| | | | | | | | | |
| | | 0.08-0.13 | - | | | | | |
| | | 0.08-0.12 | - | | | | | |
| | | 0.08-0.12 | - | | | | | |
| | | - | - | | | | | |
| | | - | - | | | | | |

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 20,000億円 6/30 ~ 7/1 (1日間) 応札 801億円 落札 801億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)
 米ドル資金供給(固定金利方式) 7/2~7/9 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.630%
 ETF買入 370億円 約定日 6/30

「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