

<<資金需給>>

単位 億円

	1日需給速報		2日需給予想		3日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 600		0	
財政		▲ 5,500	▲ 30,900		3,000	
資金過不足		▲ 6,100	▲ 31,500		3,000	
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		61,199			9,100	
国債買現		0			▲ 3,900	
CP買現		0				
国庫短期証買入						
国庫短期証売却						
国債買入		5,600			8,700	
CP等買入			▲ 100			
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		100		
国債補完供給	即日	600		200		
小計		6,300		200	13,900	
当預増減		200	▲ 31,300		16,900	

当座預金残高	2,298,600	7/1以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,084,900		2,300
積み終了先	1,743,300	7/2以降の残り所要積立額	
超過準備	1,743,300	積数	1,900
非準預先残高	213,700	1日平均	100
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	99.90% (実績)	53.33%	(日数)

6/30のマネタリーベース		3,250,500	
6/30コール合計	199,904	無担	54,683
有担	145,221		
コール前日増減	計 9,505	無担	▲ 2,249
有担	11,754		

7/1の加重平均レート(速報)				6/30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
0.020 ~0.125 (0.062)	0.030	~0.040 (0.031)				0.001 ~0.125 (0.011)		0.040 ~0.120 (0.057)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.050 ~0.120 (0.066)									
0.059 ~0.122 (0.103)								0.062 ~0.200 (0.075)	
0.118 (0.118)								0.118 ~0.175 (0.121)	
0.170 (0.170)				0.08-0.13	-				有担先日付分
				0.08-0.12	-				
				0.08-0.12	0.0000				
				-	-				
				-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	15,000億円	7/3	~ 10/14 (103日間)	応札	9,100億円	落札	9,100億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)	
国債補完	11,047億円	7/1	~ 7/2 (1日間)	応札	221億円	落札	221億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国債買入	700億円	7/3		応札	3,629億円	落札	708億円	按分利回り較差	0.006%	88.8%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	3,750億円	7/3		応札	11,509億円	落札	3,755億円	按分利回り較差	0.000%	38.5%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	4,250億円	7/3		応札	16,200億円	落札	4,255億円	按分利回り較差	0.008%	15.4%	平均利回り較差	0.012%

J-REIT買入 13億円 約定日 7/1

「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。」

<< 7/2の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,267,300	前日比	▲ 31,300
O/N	0.055~0.065	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.055~0.065%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 1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2,000億円減少の174兆7,000億円(当座預金残高見込みは229兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.055%の出合いが始まった。その後は一部大手行より0.06%で調達が行われたことで、0.06%が下支えとなり、地銀・信託業態を中心とした0.06~0.062%前後での出合いで推移した。四半期末要因が剥落したものの、先週のレート水準まで戻るには至らず、一巡後も0.06%前後を中心に散発的に出合う程度で本日の取引を終了した。ターム物に関しては、大きな出合いは見られなかった。

<< 1日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばい圏での動き。短国市場は、3M物が0%で出合いがみられたものの、方向感に乏しく閑散であった。CP市場は、償還総額800億円弱に対し発行総額は1,400億円程度に上った。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。

<< 2日の材料 >>
 *6月のマネタリーベース
 *7月の日銀当座預金増減要因見込み
 *米国5月の製造業新規受注・出荷・在庫
 *米国6月の雇用統計
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、7/6発行)
 *10年利付国債入札(24,000億円、7/6発行)

<<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%

JGB新発10年債	0.470	0.020	日経平均株価(終値)	20,329.32	93.59	為替(9時)	122.41-44
						為替(5時)	122.61-63

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	6/24	6/25	6/26	6/29	6/30	7/1
日銀当預残	2,276,500	2,272,100	2,285,100	2,283,200	2,298,400	2,298,600
準備預金残	2,073,300	2,065,700	2,078,600	2,077,100	2,086,100	2,084,900
レート	0.077%	0.073%	0.073%	0.072%	0.011%	0.062%
月中平均	0.07475%	0.07468%	0.07450%	0.07441%	0.07230%	0.06200%

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