

**<<資金需給>>**

単位 億円

	3日需給速報		6日需給予想	7日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 700	1,300	1,000
財政		5,400	▲ 22,300	1,000
資金過不足		4,700	▲ 21,000	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		9,100	1,800	
66,399		▲ 3,900	▲ 2,300	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				17,500
国庫短期証売却				
国債買入		8,700		7,800
CP等買入				
		▲ 400	▲ 300	
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	200	
国債補完供給		100		
小計		13,800	▲ 600	25,300
当預増減		18,500	▲ 21,600	27,300

当座預金残高	2,286,800	7/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,070,400		1,600
積み終了先	1,729,400	7/6以降の残り所要積立額	
超過準備	1,729,400	積数	1,000
非準備先残高	216,400	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	99.95% (実績)	66.67% (日数)	

7/2のマネタリーベース		3,221,500	
7/2コール	合計	195,342	無担 64,173 有担 131,169
コール前日増減	計	▲ 734	無担 1,229 有担 ▲ 1,963

7/3の加重平均レート(速報)				7/2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
0.055 ~ 0.080 (0.075)	0.030	~ 0.040 (0.031)				0.020 ~ 0.125 (0.072)		0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.069 ~ 0.120 (0.076)							0.065 ~ 0.125 (0.080)	
0.140 ~ 0.310 (0.168)						0.118 (0.118)	0.145 (0.145)	
				0.08-0.13	-			有担先日付分
				0.08-0.12	-			
				0.08-0.12	▲0.005			
				-	-			
				-	-			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	340億円	7/3	~ 7/6 (3日間)	応札	20億円	落札	20億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	17,500億円	7/7		応札	24,224億円	落札	17,501億円	按分利回り較差	-0.014%	69.3%	平均利回り較差	-0.004%
国債買入	4,000億円	7/7		応札	11,721億円	落札	4,000億円	按分利回り較差	-0.026%	60.0%	平均利回り較差	-0.023%
国債買入	2,400億円	7/7		応札	6,102億円	落札	2,402億円	按分利回り較差	-0.022%	99.3%	平均利回り較差	-0.018%
国債買入	1,400億円	7/7		応札	4,463億円	落札	1,406億円	按分利回り較差	-0.024%	22.6%	平均利回り較差	-0.020%

「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

<< 7/6の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,265,200	前日比	▲ 21,600
O/N	0.065~0.075	T/N	0.065~0.12	S/N	0.065~0.12
無担O/Nは0.065~0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

**<< 3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2兆4,000億円増加の173兆7,000億円(当座預金残高見込みは228兆7,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.07%近辺、地銀・信託業態から0.073~0.075%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.075%近辺の出合いが中心となった。一巡後は0.07~0.074%の出合いを中心に推移し、本日の取引を終了した。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

**<< 3日のオープン市場動向 >>**  
 現先S/N物は低位で推移した。短国市場は、短国買入オペが前回より7,500億円増額となる17,500億円でおファーされた。落札結果は、平均落札利回り較差▲0.004% 按分落札利回り較差▲0.014% 按分率69.3%と玉不足を反映した強めの結果となった。セカンダリーでは、3M物で▲0.005%の出合いがみられた。CP市場は、償還総額400億円弱に対し発行総額800億円程度となった。発行レートは、概ね横ばい圏での動きとなった。

**<< 6日の材料 >>**  
 \*日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)  
 \*5月の景気動向指数速報  
 \*米国6月のF R B労働市場情勢指数  
 \*米国6月のI S M非製造業景況指数

<<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%

JGB新発10年債	0.480	▲ 0.030	日経平均株価(終値)	20,539.79	17.29	為替(9時)	123.05-07
						為替(5時)	123.15-16

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	6/26	6/29	6/30	7/1	7/2	7/3
日銀当預残	2,285,100	2,283,200	2,298,400	2,298,600	2,268,300	2,286,800
準備預金残	2,078,600	2,077,100	2,086,100	2,084,900	2,054,400	2,070,400
レート	0.073%	0.072%	0.011%	0.062%	0.072%	0.075%
月中平均	0.07450%	0.07441%	0.07230%	0.06200%	0.06700%	0.07180%