

**<<資金需給>>**

単位 億円

	6日需給速報		7日需給予想	8日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,100	700	1,000
財政		▲ 22,800	300	1,000
資金過不足		▲ 21,700	1,000	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,800		
65,948		▲ 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			8,200	
CP等買入				
		▲ 300	▲ 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	300	
国債補完供給				
小計		▲ 600	25,700	0
当預増減		▲ 22,300	26,700	2,000

当座預金残高	2,264,500	7/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,049,300		1,000
積み終了先	1,711,300	7/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,711,300	積数	800
非準備先残高	215,200	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	99.96% (実績)	70.00% (日数)	

7/3のマネタリーベース		3,240,700	
7/3コール	合計	197,082	無担 64,347 有担 132,735
コール前日増減	計	1,740	無担 174 有担 1,566

7/6の加重平均レート(速報)				7/3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 ~0.125 (0.075)	0.030	~0.040 (0.031)				0.055 ~0.080 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.068 ~0.120 (0.075)							0.069 ~0.120 (0.076)	
0.081 ~0.117 (0.087)						1W	0.130 (0.130)	
0.340 (0.340)						2W	0.140 ~0.310 (0.168)	
						3W		
				0.08-0.13	-	1M		有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M		
				0.08-0.12	-	3M		
				-	-	6M		
				-	-	1Y		

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	4,000億円	7/6 ~ 7/7 (1日間)	0億円	0億円	按分	平均 (即)
国債補完	320億円	7/6 ~ 7/7 (1日間) 応札	20億円	落札 20億円	全取	平均 -0.40% (即)
ETF買入	324億円	約定日 7/6				
J-REIT買入	14億円	約定日 7/6				

「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

<< 7/7の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,291,200	前日比	26,700
O/N	0.065~0.075	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12
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。					

**<< 6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2兆6,000億円減少の171兆1,000億円(当座預金残高見込みは226兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは先週末に引き続き、地銀・信託業態から0.073~0.075%、都銀から0.07%程度での調達がみられた。一巡後は0.07%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。ターム物の出合いは閑散であった。

**<< 6日のオープン市場動向 >>**  
 現先レートS/Nは低位横ばいで推移した。短国市場は全般的に様子見気分が強く、閑散な地合いだった。CP市場は発行案件が少なく、発行総額は100億円程度となった。発行レートは特段変化なく、概ね横ばいだった。

**<< 7日の材料 >>**  
 \*6月のマネタリーベースと日本銀行の取引  
 \*米国5月の貿易収支  
 \*米国5月の消費者信用残高  
 \*10年物価連動国債入札(5,000億円、7/9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	0.459	▲ 0.021	日経平均株価(終値)	20,112.12	▲ 427.67	為替(9時)	122.42-43
						為替(5時)	122.63-65

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	6/29	6/30	7/1	7/2	7/3	7/6
日銀当預残	2,283,200	2,298,400	2,298,600	2,268,300	2,286,800	2,264,500
準備預金残	2,077,100	2,086,100	2,084,900	2,054,400	2,070,400	2,049,300
レート	0.072%	0.011%	0.062%	0.072%	0.075%	0.075%
月中平均	0.07441%	0.07230%	0.06200%	0.06700%	0.07180%	0.07233%