

<<資金需給>>

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想	9日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		800	400	▲ 1,000
財政		▲ 200	200	▲ 4,000
資金過不足		600	600	▲ 5,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
65,948				
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	▲ 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		300		
国債補完供給				
小計		25,700	▲ 100	0
当預増減		26,300	500	▲ 5,000

当座預金残高	2,290,800	7/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,067,800		800
積み終了先	1,730,400	7/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,730,400	積数	700
非準備先残高	223,000	1日平均	100
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)			1,962,900
準備預金進捗率	99.96% (実績)	73.33% (日数)	

7/6のマネタリーベース		3,217,300	
7/6コール合計	196,471	無担	64,865
コール前日増減	▲ 611	無担	518
		有担	▲ 1,129

7/7の加重平均レート(速報)			7/6の加重平均レート(確報)		
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
0.020 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.125 (0.075)	
0.069 ~0.120 (0.076)				T/N	0.068 ~0.120 (0.075)
				S/N	
0.130 ~0.200 (0.165)				1W 0.117 (0.117)	0.081 (0.081)
				2W	0.340 (0.340)
				3W	
		0.08-0.13	-	1M	
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.012~▲0.01	3M	
		-	-	6M	
		-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

CP買入 4,000億円 7/10 応札 11,671億円 落札 3,985億円 按分利回り較差 0.083% 30.8% 平均利回り較差 0.088%
 米ドル資金供給(固定金利方式) 7/9~7/16 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.630%
 10年物価連動国債(表面利率0.1%) 応札1兆1,660億円 落札5,000億円 7/9~2025/3/10 ▲0.555% 按分20.0000%
 J-REIT買入 14億円 約定日 7/7

<< 7/8の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,291,300	前日比	500
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。

<< 7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3兆円増加の174兆1,000億円(当座預金残高見込みは229兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託業態から0.073~0.075%、都銀から0.07%程度での調達で始まった。取り急ぐ動きはみられず、一日を通して昨日と同水準の0.07~0.072%前後を中心に推移し、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。

<< 7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。短国市場は閑散とした中、3M物で▲0.012~▲0.01%の出合いが散見された程度だった。CP市場は商社業態等で大型発行案件が見られたことから、発行総額は1,500億円程度と膨らんだ。発行レートは概ね横ばいだった。CP等買入オペは4,000億円で実施された。期明け後、初のオファーということもあり、各落札利回りは平均0.088%、按分0.083%と前回(0.084%、0.08%)から上昇した。

<< 8日の材料 >>

- *5月の国際収支
- *6月の景気ウォッチャー調査
- *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
- *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、7/10発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、7/16借入)

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	122.65-68
0.450 ▲ 0.009	20,376.59 264.47	為替(5時)	122.72-74

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	6/30	7/1	7/2	7/3	7/6	7/7
日銀当預残	2,298,400	2,298,600	2,268,300	2,286,800	2,264,500	2,290,800
準備預金残	2,086,100	2,084,900	2,054,400	2,070,400	2,049,300	2,067,800
レート	0.011%	0.062%	0.072%	0.075%	0.075%	0.075%
月中平均	0.07230%	0.06200%	0.06700%	0.07180%	0.07233%	0.07271%

「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