

<<資金需給>>

単位 億円

	8日需給速報		9日需給予想		10日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		400	100	▲ 1,000		
財政		2,200	▲ 3,100	▲ 20,000		
資金過不足		2,600	▲ 3,000	▲ 21,000		
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						
国庫短期証売却						
国債買入					12,000	
CP等買入					4,000	
		▲ 100	▲ 400			
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			
国債補充供給						
小計		▲ 100	▲ 200	16,000		
当預増減		2,500	▲ 3,200	▲ 5,000		

当座預金残高	2,293,300	7/8以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,070,900		700
積み終了先	1,735,700	7/9以降の残り所要積立額	
超過準備	1,735,700	積数	500
非準備先残高	222,400	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	99.97% (実績)	76.67% (日数)	

7/7のマナタリーベース		3,242,900	
7/7コール合計	202,415	無担	71,174
コール前日増減	計	5,944	無担
		6,309	有担
			▲ 365

7/8の加重平均レート(速報)			7/7の加重平均レート(確報)			単位(%)
無担(平均)	有担(平均)	CP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 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.020 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.069 ~0.120 (0.075)				T/N		
				S/N	0.069 ~0.120 (0.076)	
0.064 ~0.170 (0.097)				1W	0.130 ~0.200 (0.165)	
0.140 (0.140)				2W	0.140 (0.140)	
				3W		
		0.08-0.13	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.013	3M		
		-	▲0.027-▲0.02	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	3,750億円	7/10	応札	11,630億円	落札	3,754億円	按分利回り較差	-0.001%	53.0%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	4,250億円	7/10	応札	13,553億円	落札	4,253億円	按分利回り較差	-0.006%	73.7%	平均利回り較差	-0.003%
国債買入	4,000億円	7/10	応札	17,063億円	落札	4,011億円	按分利回り較差	-0.023%	49.9%	平均利回り較差	-0.022%
T-Bill6M	応札12兆9,204億円	落札3兆2,160億6,000万円(非競争入札:2,839億円)	7/10~2016/1/13	▲0.0156%	按分21.8516%	平均▲0.0195%					
交付税特会	1兆500億円	7/16~2016/1/15	応札3兆480億円	落札1兆500億円	0.085%	按分63.2383%	平均0.083%				
ETF買入	324億円	約定日	7/8								
J-REIT買入	14億円	約定日	7/8								

「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

<< 7/9の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,290,100	前日比	▲ 3,200
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。

<< 8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4,000億円減少の173兆7,000億円(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0.07~0.075%、都銀から0.07%程度での調達で始まった。一部業態からまとまった金額を取り上がる場面も見られたものの、総じて取り急ぐ動きはなく、一巡後は0.07%前後を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関しては、証券業態によるロール案件中心の取引となった。

<< 8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6M物の入札が実施された。WI取引で▲0.02%の出合いが見られていたこともあり、平均落札利回▲0.0195%、按分落札利回▲0.0156%と、6M物では各利回りとも過去最低となる強い入札となった。セカンダリーは▲0.027~▲0.025%の出合いが見られた。CP市場は10日発行のため発行件数が増えたほか、ノンバンク、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2,500億円程度と膨らんだ。発行レートは概ね横ばいであった。

<< 9日の材料 >>
 *5月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲5.0%)
 *5月の特定サービス産業動態統計速報 *6月のマネーストック
 *MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、7/13発行)
 *30年利付国債入札(8,000億円、7/13発行)

JGB新発10年債	0.411	▲ 0.039	日経平均株価(終値)	19,737.64	▲ 638.95	為替(9時)	122.53-55
						為替(5時)	121.65-68

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	7/1	7/2	7/3	7/6	7/7	7/8
日銀当預残	2,298,600	2,268,300	2,286,800	2,264,500	2,290,800	2,293,300
準備預金残	2,084,900	2,054,400	2,070,400	2,049,300	2,067,800	2,070,900
レート	0.062%	0.072%	0.075%	0.075%	0.075%	0.075%
月中平均	0.06200%	0.06700%	0.07180%	0.07233%	0.07271%	0.07300%