

**<<資金需給>>**

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		0	▲ 200	1,000
財政		▲ 2,900	▲ 20,700	▲ 11,000
資金過不足		▲ 2,900	▲ 20,900	▲ 10,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)				1,100
65,948				▲ 1,000
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			12,100	
CP等買入			4,000	
		▲ 400	▲ 500	
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			▲ 100	
ETF買入		200	300	
国債補充供給				
小計		▲ 200	15,800	100
当預増減		▲ 3,100	▲ 5,100	▲ 9,900

当座預金残高	2,290,200	7/9以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,069,500		500
積み終了先	1,734,800	7/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,734,800	積数	400
非準備先残高	220,700	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	99.98% (実績)	80.00% (日数)	

7/8のマネタリーベース		3,245,000	
7/8コール	合計	204,952無担	71,945有担
133,007			
コール前日増減	計	2,537無担	771有担
			1,766

7/9の加重平均レート(速報)				7/8の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		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)	0.020 ~0.125 (0.075)		0.020 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.069 ~0.130 (0.090)					0.069 ~0.120 (0.075)			
0.170 (0.170)					0.064 ~0.170 (0.097)			
					0.140 (0.140)			
0.080 (0.080)		0.08-0.13	-	1M		0.200 (0.200)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
0.200 (0.200)		0.08-0.12	▲0.077-▲0.002	3M				
		-	▲0.055-▲0.035	6M				
		-	-	1Y				

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通	8,000億円	7/13 ~ 10/13 (92日間)	応札	1,050億円	落札	1,050億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	4,000億円	7/9 ~ 7/10 (1日間)		0億円		0億円		按分	平均	(即)
T-Bill3M	応札21兆6,736億円	落札4兆6,680億5,000万円(非競争入札:4,219億円)	7/13~10/13	▲0.0059%	按分	72.0373%	平均	▲0.0087%		
30年利付国債(表面利率1.6%)	応札1兆6,318億円	落札7,376億円(I非競争入札:616億円)	7/13~2015/6/20	1.451%	按分	77.7351%	平均	1.432%		
ETF買入	324億円	約定日 7/9								
J-REIT買入	14億円	約定日 7/9								

「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。」

<< 7/10の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,285,100	前日比	▲ 5,100
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。					

**<< 9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3,000億円減少の173兆4,000億円(当座預金残高見込みは229兆円)。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%程度での調達が始まった。一巡後は0.07~0.073%前後の調達で推移し、一部業態による取り上がりも散見される中で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。3M物の共通担保オペが8,000億円オファーされ、結果は落札総額1,050億円(期落ち額950億円)で札割れとなった。

**<< 9日のオープン市場動向 >>**

現先レートS/Nは低位横ばい圏で推移した。短国市場は3M物の入札が実施され、W I取引で▲0.008~▲0.002%の出合いが見られていたこともあり、平均落札利回▲0.0087%、按分落札利回▲0.0059%と各利回りともに3M物では過去最低となる強い入札となった。セカンダリーはショートカバーと見られる買いや、短国買入オペを睨んだ動きから一時は▲0.077%の出合いをつけた。その他は、6M物で▲0.055~▲0.035%の出合いが散見されるなど全般的に気配が強含んだ。CP市場は発行案件が少なかったものの、鉄鋼業態等の大型発行案件が見られたことから発行総額は1,500億円程度となった。発行レートは概ね横ばいだった。

**<< 10日の材料 >>**

- \*6月の企業物価指数
- \*6月の消費動向調査
- \*米国5月の卸売売上高

JGB新発10年債	0.445	0.034	日経平均株価(終値)	19,855.50	117.86	為替(9時)	120.89-90
						為替(5時)	121.30-32

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	7/2	7/3	7/6	7/7	7/8	7/9
日銀当預残	2,268,300	2,286,800	2,264,500	2,290,800	2,293,300	2,290,200
準備預金残	2,054,400	2,070,400	2,049,300	2,067,800	2,070,900	2,069,500
レート	0.072%	0.075%	0.075%	0.075%	0.075%	0.075%
月中平均	0.06700%	0.07180%	0.07233%	0.07271%	0.07300%	0.07322%

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