

**<<資金需給>>**

単位 億円

	10日需給速報		13日需給予想	14日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 200	1,200	1,000
財政		▲ 20,600	▲ 14,800	▲ 24,000
資金過不足		▲ 20,800	▲ 13,600	▲ 23,000
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				17,500
国庫短期証売却				
国債買入		12,100		7,800
CP等買入		4,000		
		▲ 500	▲ 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		▲ 100		
ETF買入		300	100	
国債補完供給				
小計		15,800	▲ 100	25,300
当増減		▲ 5,000	▲ 13,700	2,300

当座預金残高	2,285,200	7/10以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,074,200		400
積み終了先	1,736,000	7/13以降の残り所要積立額	
超過準備	1,736,000	積数	100
非準備先残高	211,000	1日平均	0
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	99.99% (実績)	90.00% (日数)	

7/9のマネタリーベース		3,241,800	
7/9コール	合計	202,669	無担 69,690 有担 132,979
コール前日増減	計	▲ 2,283	無担 ▲ 2,255 有担 ▲ 28

7/10の加重平均レート(速報)				7/9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	有担当日分	有担先日付分
0.055 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.020 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.068 ~0.130 (0.080)					0.069 ~0.130 (0.090)		
0.070 ~0.095 (0.087)							
					0.170 (0.170)		
		0.08-0.13	-			0.080 (0.080)	有担先日付分
		0.08-0.12	-				
		0.08-0.12	-		0.200 (0.200)		
0.275 (0.275)		-	-				
		-	-				

7/13の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,271,500	前日比	▲ 13,700
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。

<< 10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7,000億円減少の172兆7,000億円(当座預金残高見込みは228兆5,000億円)。無担O/Nは、地銀・信託業態から0.07~0.075%、都銀から0.07%程度での調達希望で始まり、まとまった金額に対しては引き続き0.07%台後半での出合いも散見された。一巡後は0.07~0.073%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。

<< 10日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は、短国買入オペが前回と同額の17,500億円でオファーされた。引値の低い特定の銘柄を中心に落札されたとみられ、結果は全取利回較差+0.031%となった。CP市場は通信、鉄鋼業態等からの大型発行案件が見られたものの、発行件数が少なく、発行総額は1,300億円程度となった。発行レートは概ね横ばいで推移した。

<< 13日の材料 >>  
 \*5月のマネタリーサーバイ  
 \*5月の第3次産業活動指数  
 \*5月の石油等消費動態統計  
 \*米国6月の財政収支

JGB新発10年債	0.430	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	19,779.83	▲ 75.67	為替(9時)	121.69-71
						為替(5時)	122.19-21

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	7/3	7/6	7/7	7/8	7/9	7/10
日銀当預残	2,286,800	2,264,500	2,290,800	2,293,300	2,290,200	2,285,200
準備預金残	2,070,400	2,049,300	2,067,800	2,070,900	2,069,500	2,074,200
レート	0.075%	0.075%	0.075%	0.075%	0.075%	0.076%
月中平均	0.07180%	0.07233%	0.07271%	0.07300%	0.07322%	0.07392%

**<<オペ情報、入札結果>>**

国短買入	17,500億円	7/14	応札	43,368億円	落札	17,500億円	全取利回り較差	0.031%	平均利回り較差	0.031%	
国債買入	4,000億円	7/14	応札	9,843億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.002%	84.7%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	2,400億円	7/14	応札	6,869億円	落札	2,406億円	按分利回り較差	0.002%	33.3%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	1,400億円	7/14	応札	4,643億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	0.003%	15.0%	平均利回り較差	0.007%

「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