

<<資金需給>>

単位 億円

	13日需給速報		14日需給予想	15日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,200	100	0
財政		▲ 16,200	▲ 23,200	2,000
資金過不足		▲ 15,000	▲ 23,100	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,100		
66,048		▲ 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			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		100	100	
国債補完供給				
小計		▲ 100	25,500	0
当預増減		▲ 15,100	2,400	2,000

当座預金残高	2,270,100	7/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,056,600		100
積み終了先	1,717,400	7/14以降の残り所要積立額	
超過準備	1,717,400	積数	0
非準備先残高	213,500	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	100.00% (実績)		93.33% (日数)

7/10のマナターベース		3,237,000	
7/10コール	合計	198,249	無担 66,502 有担 131,747
コール前日増減	計	▲ 4,420	無担 ▲ 3,188 有担 ▲ 1,232

7/13の加重平均レート(速報)				7/10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	単位(%)
0.060 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.125 (0.076)					0.068 ~0.130 (0.080)		
0.069 ~0.096 (0.092)					0.070 ~0.095 (0.087)		
0.175 ~0.310 (0.214)							
0.170 (0.170)		0.08-0.13	-				有担先日付分
		0.08-0.12	-				
		0.08-0.12	-				
		-	-				
		-	-		0.275 (0.275)		
		-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完	4,000億円	7/13 ~ 7/14 (1日間)	0億円	0億円	按分	平均	(即)
社債買入	1,250億円	7/17 応札	2,520億円 落札	1,250億円	按分レート	0.056%	2.5% 平均落札レート 0.086%

「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。」

<< 7/14の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,272,500	前日比	2,400
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%前後での出会いが中心になると見込まれる。					

<< 13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6,000億円減少の172兆1,000億円(当座預金残高見込みは227兆2,000億円)。無担O/Nは先週末とほぼ同様の水準で、地銀・信託業態から0.075%前後、都銀から0.07%程度での調達希望で始まった。まとまった金額に対しては引き続き0.07%台後半での出会いも散見されたが、一巡後は大方のビッド水準が低下し、0.069~0.072%程度の出会いが散見される中で本日の取引を終えた。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。

<< 13日のオープン市場動向 >>
 短国現先レート、S/Nは前日から横ばい圏であった。短国アウトライト市場は前週からの流れを引き継ぎ、売り物が無く閑散で、目立った出会いはみられなかった。CP市場は五・十日に係る発行となり、機械・通信・建設業態からのまとまった発行案件がみられた。ただ、償還総額3,700億円程度に比べると、発行総額は2,000億円程度とやや少なめだった。発行レートは概ね横ばい圏での取引となった。

<< 14日の材料 >>
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、15日まで)
 *米国5月の企業在庫
 *米国6月の小売売上高
 *英国6月の消費者物価指数
 *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、7/21発行)
 *流動性供給入札(3,000億円、7/16発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、7/24借入)

JGB新発10年債	0.440	0.010	日経平均株価(終値)	20,089.77	309.94	為替(9時)	122.49-51
						為替(5時)	123.32-34

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	7/6	7/7	7/8	7/9	7/10	7/13
日銀当預残	2,264,500	2,290,800	2,293,300	2,290,200	2,285,200	2,270,100
準備預金残	2,049,300	2,067,800	2,070,900	2,069,500	2,074,200	2,056,600
レート	0.075%	0.075%	0.075%	0.075%	0.076%	0.075%
月中平均	0.07233%	0.07271%	0.07300%	0.07322%	0.07392%	0.07400%

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