

**<<資金需給>>**

単位 億円

	14日需給速報		15日需給予想	16日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	▲ 100	▲ 1,000
財政		▲ 23,200	3,200	▲ 3,000
資金過不足		▲ 23,000	3,100	▲ 4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
66,048				
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	▲ 600	
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	
国債補充供給				
小計		25,500	▲ 500	0
当預増減		2,500	2,600	▲ 4,000

当座預金残高	2,272,600	7/14以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,065,000		0
積み終了先	1,728,000	7/15以降の残り所要積立額	
超過準備	1,728,000	積数	0
非準備先残高	207,600	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)	96.67% (日数)

7/13のマナタリーベース		3,220,700	
7/13コール合計	204,258	無担	69,764
コール前日増減	計	有担	134,494
	6,009	無担	3,262
		有担	2,747

7/14の加重平均レート(速報)			7/13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 ~0.130 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.075)	
0.068 ~0.125 (0.087)				T/N	0.050 ~0.120 (0.076)
				S/N	
				1W	0.069 ~0.096 (0.092)
0.116 ~0.175 (0.146)				2W	0.175 ~0.310 (0.214)
				3W	
		0.08-0.13	-	1M	0.170 (0.170)
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	-	3M	
		-	▲0.02	6M	
		-	▲0.035-▲0.01	1Y	

**<<オペ情報、入札結果>>**

米ドル資金供給(固定金利方式) 7/16~7/23 (7日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.620%  
 T-Bill 1Y 応札9兆2,219億円 落札2兆2,930億6,000万円(非競争入札:2,069億円) 7/21~2016/7/20 ▲0.0109% 按分53.0555% 平均▲0.0189%  
 流動性供給 応札 9,278億円 落札 2,993億円 7/16 募入最大利回差 0.023% 按分 54.5197% 募入平均利回差 0.020%  
 交付税特会 1兆500億円 7/24~2016/1/22 応札 2兆7,850億円 落札 1兆500億円 0.084% 按分 75.0000% 平均 0.082%

「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。」

<< 7/15の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,275,200	前日比	2,600
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。					

<< 14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2,000億円増加の172兆3,000億円(当座預金残高見込みは227兆3,000億円)。無担O/Nは昨日に引き続き、地銀・信託業態から0.075%前後、都銀から0.07%程度での調達が行われた。まとまった金額に対しては0.07%台後半での出合いも散見されたが、徐々に出合い水準は低下し、最終的には0.065%近辺での出合いで本日の取引を終えた。ターム物については、出合い閑散であった。

<< 14日のオープン市場動向 >>  
 短国現先レートS/Nは前日から小幅上昇した。短国1Y物の入札については、WI取引で▲0.035~▲0.03%と強めの出合いが見られる中、按分落札レート▲0.0109%(按分比率53.0555%)、平均落札レート▲0.0189%と若干流れた結果となった。なお、平均落札レートは1Y物では過去最低となった。セカンダリーでは▲0.0109~▲0.010%で小額の出合い。CP市場は通信等の業態から大型の発行案件が見られ、償還総額800億円程度に対し、発行総額は1,900億円程度となった。発行レートは銘柄間でややばらつきがあったものの、概ね横ばい圏との印象であった。

- << 15日の材料 >>
- \*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
  - \*黒田日銀総裁、定例会見
  - \*経済・物価情勢の展望(中間評価)
  - \*イエレンFRB議長、米下院にて議会証言
  - \*米国ページブック
  - \*米国6月の生産者物価指数
  - \*米国6月の鉱工業生産・設備稼働率

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	123.60-62
0.455	0.015	20,385.33	295.56
		為替(5時)	123.45-46

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	7/7	7/8	7/9	7/10	7/13	7/14
日銀当預残	2,290,800	2,293,300	2,290,200	2,285,200	2,270,100	2,272,600
準備預金残	2,067,800	2,070,900	2,069,500	2,074,200	2,056,600	2,065,000
レート	0.075%	0.075%	0.075%	0.076%	0.075%	0.076%
月中平均	0.07271%	0.07300%	0.07322%	0.07392%	0.07400%	0.07414%

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