

<<資金需給>>

単位 億円

	15日需給速報		16日需給予想	17日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 1,200	▲ 1,000
財政		3,400	▲ 800	3,000
資金過不足		3,300	▲ 2,000	2,000
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				
国庫短期証売却				
国債買入				
CP等買入		▲ 600	▲ 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				1,300
ETF買入		100		
国債補完供給				
小計		▲ 500	▲ 400	1,300
当増減		2,800	▲ 2,400	3,300

当座預金残高	2,275,400	7/15以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	2,062,700		
積み終了先	1,725,800	7/16以降の残り所要積立額	
超過準備	1,725,800	積数	2,021,900
非準備先残高	212,700	1日平均	65,200
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,962,900		
7月の新所要見込	65,200	(一日平均)	

7/14のマナリーベース				3,222,900
7/14コール	合計	199,056	無担	65,594
			有担	133,462
コール前日増減	計	▲ 5,202	無担	▲ 4,170
			有担	▲ 1,032

7/15の加重平均レート(速報)							
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国				
0.055 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.020 ~0.130 (0.076)		
0.068 ~0.125 (0.077)				T/N		0.068 ~0.125 (0.087)	
				S/N			
0.064 ~0.130 (0.089)				1W			
0.076 (0.076)				2W		0.116 ~0.175 (0.146)	
				3W			
		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M			
		0.08-0.12	▲0.077	3M			
		-	▲0.035	6M			
		-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 712億円 7/15 ~ 7/16 (1日間) 応札 1億円 落札 1億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

<<日銀金融政策決定会合・結果>>
 ・マナリーベースが、年間約80兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(賛成8反対1)
 ・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)
 ①長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。買入れの平均残存期間は7年~10年程度とする。
 ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約3兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 ③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

「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。」

7/16の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,273,000	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%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 15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1兆1,000億円増加の173兆4,000億円(当座預金残高見込みは227兆5,000億円)。無担O/Nは地銀・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。積み最終日となるものの、昨日と同様の水準で推移し、まとまった金額に対しては昨日同様に0.07%台後半での出合いも散見された。一巡後は0.065~0.07%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、出合いは閑散であった。日銀金融政策決定会合は現状維持が決定された。

<< 15日のオープン市場動向 >>
 短国現先レートS/Nは前日からほぼ変わらず。短国アウトライイト市場は閑散で、3M:▲0.077%、6M:▲0.035%で小額の出合いがみられた程度であった。CP市場は石油・機械等の業態からまとまった発行案件が見られ、償還総額500億円程度に対し、発行総額は1,900億円程度まで膨らんだ。発行レートは、7月償還を中心とした短めの期間でやや上昇した印象であった。

<< 16日の材料 >>
 *金融経済月報
 *イエレンFRB議長、米上院にて議会証言
 *ECB定例理事会(金融政策発表)
 *ユーロ圏6月の消費者物価指数改定値
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、7/21発行)
 *5年利付国債入札(25,000億円、7/21発行)

◀コール6月積み期間分の加重平均レート▶			
(土日を含む)	無担	0.07193%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07100%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.450	▲ 0.005
日経平均株価(終値)	20,463.33	78.00
為替(9時)	123.33-35	
為替(5時)	123.52-53	

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	7/8	7/9	7/10	7/13	7/14	7/15
日銀当預残	2,293,300	2,290,200	2,285,200	2,270,100	2,272,600	2,275,400
準備預金残	2,070,900	2,069,500	2,074,200	2,056,600	2,065,000	2,062,700
レート	0.075%	0.075%	0.076%	0.075%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07300%	0.07322%	0.07392%	0.07400%	0.07414%	0.07427%

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