

**<<資金需給>>**

単位 億円

	17日需給速報		21日需給予想	22日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	800	0
財政		3,300	▲ 55,600	1,000
資金過不足		2,400	▲ 54,800	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			1,000	
66,048			▲ 1,300	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				25,000
国庫短期証売却				
国債買入				11,800
CP等買入				4,000
貸出支援基金		▲ 300	▲ 600	
(成長) 48,511				
(増加) 244,836				
被災地支援				
3,241				
社債等買入		1,300		
		▲ 100		
ETF買入				300
国債補完供給				
小計		900	▲ 600	40,800
当預増減		3,300	▲ 55,400	41,800

<< 7/21の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,221,600	前日比	▲ 55,400
O/N	0.065~0.075	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

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。

<< 17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1,000億円減少の172兆2,000億円(当座預金残高見込みは227兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀・地銀・信託業態から0.06~0.075%近辺の調達希望で始まり、立ち上がりは0.075%近辺の出合いが中心となった。まとまった金額の取引に関しては0.07%台後半の出合いも散見されたものの、一巡後は徐々に取り下がり、後場にかけては0.07%近辺での出合いに落ち着いた。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<< 17日のオープン市場動向 >>  
 短国現先レート、S/Nは前日からやや低下した。短国アウトライト市場では3M:▲0.002%で小額の出合いが見られた程度であった。短国買入オペが2兆5,000億円と通知され、按分利回較差+0.005%、平均利回較差+0.01%、按分比率70.7%と、無難な結果となった。CP市場は償還総額1,000億円程度に対し、発行総額は1,000億円程度となった。商社等のまとまった発行案件が見られたが、全体の件数が少なかった。発行レートは概ね横ばい圏との印象であった。

- << 21日の材料 >>  
 \*日銀金融政策決定会合議事要旨(6月18・19日開催分)  
 \*月例経済報告  
 \*5月の景気動向指数改訂状況

<<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%

当座預金残高	2,277,000	7/17以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,060,800		752,300
積み終了先	1,707,700	7/21以降の残り所要積立額	
超過準備	1,554,000	積数	67,900
非準備先残高	216,200	1日平均	2,600
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)			2,021,900
準備預金進捗率	96.64%	(実績)	16.13% (日数)

JGB新発10年債	0.420	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	20,650.92	50.80	為替(9時)	124.16-18
						為替(5時)	124.00-02

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	7/10	7/13	7/14	7/15	7/16	7/17
日銀当預残	2,285,200	2,270,100	2,272,600	2,275,400	2,273,700	2,277,000
準備預金残	2,074,200	2,056,600	2,065,000	2,062,700	2,056,700	2,060,800
レート	0.076%	0.075%	0.076%	0.076%	0.075%	0.074%
月中平均	0.07392%	0.07400%	0.07414%	0.07427%	0.07431%	0.07425%

7/16のマナタリーベース			
7/16コール合計	196,964	無担	62,926
		有担	134,038
コール前日増減	計	1,144	無担
		1,467	有担
			▲ 323

7/17の加重平均レート(速報)				7/16の加重平均レート(確報)				単位(%)
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	
0.020 ~0.080 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.020 ~0.125 (0.075)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.068 ~0.120 (0.077)					0.068 ~0.120 (0.077)			
0.130 (0.130)					0.069 ~0.130 (0.097)			
0.115 ~0.340 (0.129)				2W 0.118 (0.118)	0.117 ~0.310 (0.120)			
				3W				
0.280 (0.280)		0.08-0.13	-	1M			有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
0.080 (0.080)		0.08-0.12	▲0.002	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	8,039億円	7/17	~ 7/21 (4日間)	応札	17億円	落札	17億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
国短買入	25,000億円	7/22		応札	55,610億円	落札	25,001億円	0.005%	70.7%	平均利回り較差	0.010%
国債買入	3,750億円	7/22		応札	17,499億円	落札	3,750億円	0.005%	93.8%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,250億円	7/22		応札	15,470億円	落札	4,254億円	0.002%	9.9%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,400億円	7/22		応札	8,507億円	落札	2,405億円	-0.003%	75.1%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	1,400億円	7/22		応札	5,288億円	落札	1,404億円	0.001%	88.0%	平均利回り較差	0.004%
被災地支援(第51回)	7/24~2016/7/22 (364日間) 貸付予定総額 1,105億円 貸付利率 0.10%										

「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