

◀資金需給▶

単位 億円

	30日需給速報		1日需給予想	2日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	400	1,000
財政		▲ 13,700	▲ 1,600	▲ 23,000
資金過不足		▲ 13,600	▲ 1,200	▲ 22,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,600		
118,759		▲ 1,000		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			15,000	
国庫短期証売却				
国債買入			6,400	
CP等買入		4,300		
		▲ 6,900	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488				
被災地支援				
3,785				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		▲ 2,100	21,400	0
当預増減		▲ 15,700	20,200	▲ 22,000
当座預金残高	1,523,200	6/30以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,394,000		24,600	
積み終了先	1,165,800	7/1以降の残り所要積立額		
超過準備	1,165,800		積数	21,100
非準備先残高	129,200		1日平均	1,400
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,841,300			
準備預金進捗率	98.85%	(実績)	50.00%	(日数)

6/27のマネタリーベース		2,450,200	
6/27コール	合計	161,730	無担 64,508 有担 97,222
コール前日増減	計	▲ 2,494	無担 ▲ 3,433 有担 939

6/30の加重平均レート(速報)			6/27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
0.040 ~0.080 (0.058)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.050 ~0.135 (0.066)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.063 ~0.122 (0.069)				T/N	0.050 ~0.122 (0.055)	
				S/N		
0.087 ~0.400 (0.134)				1W		
0.140 (0.140)				2W	0.118 (0.118)	
0.145 (0.145)				3W	0.115 (0.115)	
0.118 ~0.160 (0.132)		0.08-0.12	-	1M	0.118 ~0.145 (0.121)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	0.0300	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完 28億円 6/30 ~ 7/1 (1日間) 応札 28億円 落札 28億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

「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

◀ 7/1の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,543,400	前日比	20,200
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での出合いが中心となろう。

◀ 30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、前日と同水準の116兆9,000億円(当座預金残高見込みは152兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀業態から0.05~0.06%、信託・証券業態から0.06%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.06%近辺を中心とした出合い。調達意欲は弱く、一巡後は一斉に取り下がり、0.05~0.055%での出合いを中心に推移した。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

◀ 30日のオープン市場動向 ▶  
 現先レートS/Nは、概ね横ばい。短国市場は、低位で推移していることから動意に乏しく、3M:0.03%の出合いが見られた程度であった。CP市場は、発行件数が少ないことに加えて、調達金額も少なかったことから、発行総額200億円未満と小額にとどまった。発行レートは、概ね横ばい。

◀ 1日の材料 ▶  
 \*5月の毎月勤労統計調査速報  
 \*6月調査の日銀短観(概要及び要旨)  
 市場予想：大企業・製造業の業況判断指数(DI)：+15  
 \*6月実績/7月見込み財政資金対民間収支  
 \*米国5月の建設支出  
 \*米国6月のISM製造業景況指数

◀コール6月の加重平均レート▶			
(土日を含む)	無担	0.06723%	有担 0.04100%
(営業日のみ)	無担	0.06705%	有担 0.04100%

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.565	0.005	15,162.10	67.10	101.43-44	
				101.38-39	

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	6/23	6/24	6/25	6/26	6/27	6/30
日銀当預残	1,507,800	1,528,700	1,534,900	1,528,500	1,538,900	1,523,200
準備預金残	1,363,600	1,387,500	1,390,900	1,389,400	1,405,800	1,394,000
レート	0.065%	0.066%	0.069%	0.066%	0.066%	0.058%
月中平均	0.06783%	0.06775%	0.06780%	0.06773%	0.06755%	0.06723%