

## <<資金需給>>

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		500	▲ 100	0
財政		▲ 27,100	2,500	2,000
資金過不足		▲ 26,600	2,400	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
118,759				
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			9,200	
CP等買入				
		▲ 100	▲ 200	
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				
ETF買入		100		
国債補完供給	即日	▲ 100	100	
小計		▲ 100	9,100	0
当預増減		▲ 26,700	11,500	2,000

当座預金残高	1,516,300	7/2以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,377,300		18,100
積み終了先	1,151,700	7/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,151,700	積数	15,600
非準備先残高	139,000	1日平均	1,200
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	99.15% (実績)	56.67%	(日数)

7/1のマナタリーベース		2,453,700	
7/1コール合計	152,808	無担	54,568
		有担	98,240
コール前日増減	計	▲ 8,730	無担 ▲ 1,300
			有担 ▲ 7,430

7/2の加重平均レート(速報)				7/1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(%)
0.050 ~0.135 (0.065)	0.040 ~0.050 (0.041)			0.055 ~0.135 (0.065)		0.040 ~0.050 (0.041)	
0.063 ~0.065 (0.064)					0.060 ~0.122 (0.064)		
					0.073 ~0.200 (0.119)		
0.117 ~0.130 (0.124)					0.118 ~0.330 (0.145)		
0.118 ~0.330 (0.153)							
		0.08-0.12	-	1M	0.270 (0.270)	0.118 ~0.180 (0.125)	有担先日付分
		0.08-0.12	0.045~0.055	2M			
		0.08-0.12	0.035~0.05	3M			
		-	-	6M			
		-	0.0300	1Y			

## <<オペ情報、入札結果>>

国債補完 2,000億円 7/2 ~ 7/3 (1日間) 応札 87億円 落札 87億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

<< 7/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,527,800	前日比	11,500
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。

<< 2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2兆6000億円減の115兆6,000億円(当座預金残高見込みは151兆6,000億円)。本日の無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.061~0.065%での調達、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。税揚げ日という事で大幅な資金不足日となったものの、150億円を超える当座預金残高を背景に、終日落ち着いた取引となった。ターム物は、ロール案件が数件見られた。

<< 2日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは、若干上昇して推移した。短国市場は、2M:0.045~0.055%、3M:0.035~0.05%、1Y:0.03%の出合いと甘い展開であった。CP市場は、自動車や建設業態からまとまった発行が実施され、発行総額は1,300億円程度となった。発行レートの目線に特段の変化は見られなかった。

<< 3日の材料 >>  
 \*ECB定例理事会(金融政策発表あり)  
 \*米国5月の貿易収支 \*米国6月の雇用統計  
 \*米国6月のISM非製造業景況指数  
 \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、7/7発行)  
 \*10年利付国債入札(24,000億円、7/7発行)

<<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)	101.55-56
0.560 0.010	15,369.97 43.77	為替(5時)	101.49-50

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	6/25	6/26	6/27	6/30	7/1	7/2
日銀当預残	1,534,900	1,528,500	1,538,900	1,523,200	1,543,000	1,516,300
準備預金残	1,390,900	1,389,400	1,405,800	1,394,000	1,405,900	1,377,300
レート	0.069%	0.066%	0.066%	0.058%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06780%	0.06773%	0.06755%	0.06723%	0.06500%	0.06500%

「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