

《資金需給》

単位 億円

	9日需給速報		10日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		500	▲ 400	▲ 1,000
財政		▲ 1,700	▲ 8,200	1,000
資金過不足		▲ 1,200	▲ 8,600	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
117,699				
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		6,500		5,100
CP等買入		4,000		
		▲ 100	▲ 500	
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	▲ 200	200	
小計		10,200	▲ 200	5,100
当預増減		9,000	▲ 8,800	5,100
当座預金残高	1,538,500	7/9以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,398,100	6,100		
積み終了先	1,180,700	7/10以降の残り所要積立額		
超過準備	1,180,700	積数		
非準備先残高	140,400	1日平均		
		900		
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額(積数)	1,852,500			
準備預金進捗率	99.72% (実績)	80.00% (日数)		

7/8のマナタリーベース		2,438,000	
7/8コール	合計	150,646	無担 55,207 有担 95,439
コール前日増減	計	1,054	無担 3,445 有担 ▲ 2,391

7/9 の加重平均レート(速報)			7/8 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
0.050 ~0.150 (0.066)	0.040 ~0.050 (0.041)			O/N 0.050 ~0.135 (0.066)		0.040 ~0.050 (0.041)
0.062 ~0.120 (0.067)				T/N	0.062 ~0.125 (0.068)	
				S/N		
0.073 ~0.130 (0.087)				1W	0.071 ~0.200 (0.119)	
0.270 (0.270)				2W	0.145 (0.145)	
				3W		
0.260 (0.260)		0.08-0.12	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	0.0250	2M		
		0.08-0.12	-	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

《オペ情報、入札結果》

国債補完	4,000億円	7/9	~ 7/10 (1日間)	応札 154億円	落札 154億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
国債買入	1,100億円	7/11	応札 5,884億円	落札 1,104億円	按分利回り較差	0.003%	66.0%	平均利回り較差 0.004%
国債買入	4,000億円	7/11	応札 13,795億円	落札 4,007億円	按分利回り較差	-0.004%	5.1%	平均利回り較差 -0.003%
ETF買入	144億円	約定日 7/9						

「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録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

《 7/10の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,529,700	前日比	▲ 8,800
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12
無担O/Nは0.06%台前半での出合いが中心となろう。					

《 9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1兆3,000億円増の118兆7,000億円(当座預金残高見込みは154兆円)。無担O/Nは、地銀・信託・証券業態から0.06~0.063%、大手行・系統機関からは0.06%での調達で始まった。当座預金残高が過去最高水準に迫るなか、調達ニーズは限定的で、出合い一巡後は閑散とした状況となり、本日の取引を終えた。ターム物は、ロール案件が見られた程度であった。

《 9日のオープン市場動向 》
 現先S/N物は横ばい圏で推移となった。短国市場は売り物なく閑散で、2M0.025%で小額の出合いが見られた程度であった。CP市場は償還総額900億円程度に対し、電機・食品・金融業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は2,000億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での動きが続いていた。

《 10日の材料 》
 *5月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+0.7%)
 *5月の第3次産業活動指数
 *6月の企業物価指数 *6月の消費動向調査
 *MPC(英中銀金融政策委員会、2日目)
 *米国5月の卸売売上高
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、7/14発行)
 *30年利付国債入札(7,000億円、7/14発行)

JGB新発10年債	0.545	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	15,302.65	▲ 11.76	為替(9時)	101.46-47
						為替(5時)	101.65-66

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	7/2	7/3	7/4	7/7	7/8	7/9
日銀当預残	1,516,300	1,527,500	1,531,700	1,502,100	1,529,500	1,538,500
準備預金残	1,377,300	1,390,300	1,400,200	1,365,500	1,392,100	1,398,100
レート	0.065%	0.065%	0.066%	0.065%	0.066%	0.066%
月中平均	0.06500%	0.06500%	0.06550%	0.06543%	0.06550%	0.06556%