

<<資金需給>>

単位 億円

	23日需給速報		24日需給予想		25日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		0	▲ 1,500	▲ 1,000		
財政		▲ 25,700	▲ 3,100	▲ 7,000		
資金過不足		▲ 25,700	▲ 4,600	▲ 8,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		9,700		10,100		
106,121		▲ 12,700		▲ 11,800		
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入		30,000				
国庫短期証売却						
国債買入			5,200			
CP等買入						
		▲ 100	▲ 300			
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488						
被災地支援				1,100		
3,785				▲ 1,300		
社債等買入			▲ 200			
ETF買入			100			
国債補完供給	即日	▲ 100	100			
小計		26,800	4,900	▲ 1,900		
当増減		1,100	300	▲ 9,900		

当座預金残高	1,510,800	7/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,383,900		115,900
積み終了先	1,152,400	7/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,150,000	積数	100,600
非準預先残高	126,900	1日平均	4,400
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)			1,907,100
準備預金進捗率	94.72% (実績)	25.81% (日数)	

7/22のマナタリーベース				2,417,600
7/22コール	合計	166,970	無担	69,928
			有担	97,042
コール前日増減	計	3,333	無担	3,165
			有担	168

7/23の加重平均レート(速報)			7/22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	無担当日分	無担先日付分	有担当日分	
0.050 ~0.135 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)		0.050 ~0.135 (0.066)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.063 ~0.120 (0.076)				0.050 ~0.120 (0.073)		
0.117 ~0.130 (0.120)				0.071 ~0.200 (0.118)		
0.118 (0.118)		0.08-0.12				有担先日付分
		0.08-0.12				
0.120 (0.120)		0.08-0.12				
		-				
		-				
		-				
		0.0150				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 15,000億円 7/25 ~ 11/5 (103日間) 応札 10,140億円 落札 10,140億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 国債補完 2,000億円 7/23 ~ 7/24 (1日間) 応札 52億円 落札 52億円 -0.400% 全取 平均 -0.404% (即)
 20年利付国債(表面利率1.5%) 応札4兆1,116億円 落札1兆907億円(I非競争入札:1,085億円) 7/25~2034/6/20 1.413% 按分34.0836% 平均1.409%
 交付税特会 1兆500億円 7/31~2015/1/29 応札 3兆1,995億円 落札 1兆500億円 0.099% 按分 77.7778% 平均 0.099%

<< 7/24の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,511,100	前日比	300
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%近辺での出合いが中心となるであろう。

<< 23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116兆円(当座預金残高見込みは151兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.06%前半、大手行からは0.06%近辺での調達希望で始まった。出合いの中心は0.063%と昨日と同様落ち着いた立ち上がりとなった。一巡後は0.06%近辺での出合いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が1W物0.117%、2W、1M物0.118%で調達を行った。

<< 23日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは引き続き高止まりの出合いとなった。短国アウトライイト市場は1Y0.015%で小額の出合いが見られた程度で、閑散であった。CP市場は25日発行の案件が見られたことから、発行総額は2,900億円程度まで膨らんだ。現先レート上昇の影響から、一部の銘柄ではレート上昇が見られた。

<< 24日の材料 >>
 *6月の貿易統計
 *米国6月の新築一戸建て販売件数
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、7/28発行)

JGB新発10年債	0.535	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	15,328.56	▲ 14.72	為替(9時)	101.47-49
						為替(5時)	101.37-38

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	7/15	7/16	7/17	7/18	7/22	7/23
日銀当預残	1,530,900	1,533,900	1,533,500	1,530,100	1,509,700	1,510,800
準備預金残	1,394,000	1,393,600	1,395,600	1,400,200	1,373,300	1,383,900
レート	0.065%	0.065%	0.065%	0.068%	0.066%	0.067%
月中平均	0.06533%	0.06531%	0.06529%	0.06581%	0.06582%	0.06587%

「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の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