

<<資金需給>>

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想		28日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,400	▲ 1,100	▲ 1,000		
財政		▲ 2,900	▲ 9,200	▲ 13,000		
資金過不足		▲ 4,300	▲ 10,300	▲ 12,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)			10,100	4,000		
106,121			▲ 11,800	▲ 6,000		
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		5,200		5,300		
CP等買入						
		▲ 300	▲ 500			
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	▲ 200			
ETF買入		100				
国債補完供給		100				
小計		4,900	▲ 2,600	3,300		
当預増減		600	▲ 12,900	▲ 8,700		

当座預金残高	1,511,400	7/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,381,200		100,600
積み終了先	1,149,100	7/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,149,100	積数	88,100
非準備先残高	130,200	1日平均	4,000
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	95.38% (実績)	29.03% (日数)	

7/23のマナタリーベース				2,418,800
7/23コール	合計	165,670	無担	69,377
			有担	96,293
コール前日増減	計	▲ 1,300	無担	▲ 551
			有担	▲ 749

7/24 の加重平均レート(速報)			7/23 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
0.045 ~0.135 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.135 (0.067)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.065 ~0.120 (0.082)					0.063 ~0.120 (0.076)	
0.121 (0.121)						
					0.117 ~0.130 (0.118)	
0.118 ~0.340 (0.125)					0.118 (0.118)	
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	0.0220-0.0300	3M	0.120 (0.120)	
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

<< 7/25の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,498,500	前日比	▲ 12,900
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%近辺での出合いが中心となるであろう。

<< 24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、116兆2,000億円(当座預金残高見込みは151兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.063~0.064%、大手行からは0.06%近辺での調達希望で始まり、出合いの中心は0.064~0.065%となった。また一部業態が試し取りを行い、0.125%で少額の出合いが見られた。一巡後も朝方の地合いを引き継ぎ、0.063~0.064%での出合いが見られた。後場に入ると、ビッドが薄くなり、目立った出合いもなく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。

<< 24日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは0.10%近辺で推移した。短国アウトライト市場は3M物の入札が実施され、WI取引において0.022~0.025%の出合いも見られたが、平均落札利回0.0264%、最高落札利回0.0300%と落ち着いた結果になった。セカンダリーは0.028~0.030%の出合いが見られた程度であった。CP市場は件数少なく閑散で、660億円程度の発行にとどまった。発行レートは残高の膨らんでいる銘柄を中心に上昇基調であった。

<< 25日の材料 >>
 *6月全国・7月都区部消費者物価指数(CPI)
 市場予想: 全 国(6月)前年同月比(除く生鮮): +3.3%
 東京都区部(7月)前年同月比(除く生鮮): +2.7%
 *6月の企業向けサービス価格指数
 *英国4-6月期のGDP速報値
 *米国6月の耐久財新規受注
 *流動性供給入札(4,000億円、7/29発行)

JGB新発10年債	0.520	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	15,284.42	▲ 44.14	為替(9時)	101.52-53
						為替(5時)	101.45-46

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	7/16	7/17	7/18	7/22	7/23	7/24
日銀当預残	1,533,900	1,533,500	1,530,100	1,509,700	1,510,800	1,511,400
準備預金残	1,393,600	1,395,600	1,400,200	1,373,300	1,383,900	1,381,200
レート	0.065%	0.065%	0.068%	0.066%	0.067%	0.067%
月中平均	0.06531%	0.06529%	0.06581%	0.06582%	0.06587%	0.06592%

<<オペ情報、入札結果>>
 全店共通 8,000億円 7/28 ~ 10/27 (91日間) 応札 4,000億円 落札 4,000億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 国債補完 2,000億円 7/24 ~ 7/25 (1日間) 応札 42億円 落札 42億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 国債買入 4,000億円 7/28 応札 13,000億円 落札 4,012億円 按分利回り較差 -0.009% 58.9% 平均利回り較差 -0.008%
 国債買入 1,000億円 7/28 応札 2,658億円 落札 1,001億円 按分利回り較差 -0.010% 30.2% 平均利回り較差 -0.008%
 国債買入 300億円 7/28 応札 1,312億円 落札 300億円 按分利回り較差 -0.019% 20.0% 平均利回り較差 -0.013%
 T-Bill3M 応札32兆999億円 落札5兆2,308億9,000万円(非競争入札:4,790億4,000万円) 7/28~10/27 0.0300% 按分44.5123% 平均0.0264%

「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