

**<<資金需給>>**

単位 億円

	31日需給速報		1日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 600	▲ 700	2,000
財政		▲ 1,300	▲ 1,800	▲ 40,000
資金過不足		▲ 1,900	▲ 2,500	▲ 38,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			12,900	2,900
104,598			▲ 10,400	▲ 4,900
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			6,400	
CP等買入		▲ 4,300		
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488				
被災地支援				
3,623				
社債等買入				
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 4,300	8,900	▲ 2,000
当増減		▲ 6,200	6,400	▲ 40,000

当座預金残高	1,520,600	7/31以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,389,500		35,500
積み終了先	1,169,600	8/1以降の残り所要積立額	
超過準備	1,169,600	積数	30,000
非準備先残高	131,100	1日平均	2,000
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	1,905,400		
準備預金進捗率	98.43%	(実績)	51.61% (日数)

7/30のマナタリーベース		2,437,500	
7/30コール	合計	179,110	無担 78,977 有担 100,133
コール前日増減	計	4,669	無担 2,911 有担 1,758

7/31の加重平均レート(速報)			7/30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 ~0.135 (0.065)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.050 ~0.135 (0.065)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.122 (0.077)					0.064 ~0.120 (0.070)		
0.117 (0.117)					0.117 ~0.130 (0.120)		
0.118 (0.118)					0.330 (0.330)		
					0.115 (0.115)		
0.118 ~0.145 (0.119)		0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M			
0.265 (0.265)		0.08-0.12	0.0255-0.032	3M			
		-	-	6M			
		-	-	1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通 8,000億円 8/4 ~ 11/4 (92日間) 応札 2,850億円 落札 2,850億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 T-Bill3M 応札 2兆8,804億円 落札 5兆1,860億5,000万円(非競争入札:4,639億円) 8/4~11/4 0.0337% 按分 15.0161% 平均 0.0289%

<< 8/1の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,527,000	前日比	6,400
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.06~0.065%近辺での出合いが中心となるであろう。

**<< 31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、117兆3,000億円(当座預金残高見込みは152兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.061~0.062%、大手行からは0.06%での調達希望で始まった。月末日を迎えたものの、出合いの中心は0.061~0.062%と落ち着いた立ち上がりとなった。一巡後はビッドが薄くなり、0.06%近辺での出合いが散見される程度で、月末日の取引を終えた。ターム物に関しては、大手行が2W、1M物0.118%での調達を行った。

**<< 31日のオープン市場動向 >>**  
 現先レートS/Nは0.07%程度で推移した。短国アウトライト市場は3M物の入札が行われた。入札結果は、平均落札利回り0.0289%、按分落札利回り0.0337%、按分比率15.0161%となり、W I取引が堅調であったには、やや流れた印象であったものの、セカンダリーでは再び小じっかりとした展開となった。CP市場は通信、ノンバンク業態等の大型案件もあり、件数は少ないながらも発行総額は2,000億円程度となった。期間の短いものについては応札姿勢が消極的で、発行レートは高めとなった。

**<< 1日の材料 >>**  
 \*7月実績/8月見込み財政資金対民間収支  
 \*黒田日銀総裁、内外情勢調査会にて講演  
 \*米国6月の個人所得・消費支出 \*米国6月の建設支出  
 \*米国7月の雇用統計 \*米国7月のISM製造業景況指数

<<コール7月の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.06626%	有担 0.03397%
(営業日のみ)	無担	0.06582%	有担 0.03427%

JGB新発10年債	0.530	0.005	日経平均株価(終値)	15,620.77	▲ 25.46	為替(9時)	102.84-85
						為替(5時)	102.86-87

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	7/24	7/25	7/28	7/29	7/30	7/31
日銀当預残	1,511,400	1,499,000	1,485,600	1,513,700	1,526,800	1,520,600
準備預金残	1,381,200	1,374,400	1,360,600	1,386,900	1,389,700	1,389,500
レート	0.067%	0.070%	0.066%	0.066%	0.065%	0.065%
月中平均	0.06592%	0.06637%	0.06636%	0.06634%	0.06630%	0.06626%

「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