

## <<資金需給>>

単位 億円

	4日需給速報		5日需給予想	6日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,300	900	1,000
財政		▲ 44,200	6,600	1,000
資金過不足		▲ 42,900	7,500	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,900		
105,038		▲ 4,900		
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			5,100	6,300
CP等買入			▲ 500	
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		▲ 2,000	34,600	6,300
当預増減		▲ 44,900	42,100	8,300
当座預金残高	1,482,800	8/4以降の残り所要積立額		
準備預金残高	1,356,700		15,700	
積み終了先	1,141,500	8/5以降の残り所要積立額		
超過準備	1,141,500		積数	13,100
非準備先残高	126,100		1日平均	1,200
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	99.31%	(実績)	64.52%	(日数)

<< 8/5の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,524,900	前日比	42,100
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%中心の取引となろう。

<< 4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4兆円減少の114兆5,000億円(当座預金残高見込みは148兆5,000億円)。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%前後での調達希望で始まり、先週末と比べて弱めの立ち上がりとなった。一巡後の出合いは、0.061~0.064%程度で推移した。午後に出合いは調整程度にとどまり、一日の取引を終えた。ターム物については、大手行が1W物0.117%、2W・1M物0.118%での調達を行った。

<< 4日のオープン市場動向 >>  
 現先レートは横ばい圏での推移となった。短国市場は全般的に様子見の展開で、3M0.024%の出合いが見られた程度であった。CP市場は入札件数・発行額共に少なく、発行総額1,000億円弱程度にとどまった。発行レートは概ね横ばいとなった。

<< 5日の材料 >>  
 \*米国6月の製造業新規受注・出荷・在庫  
 \*米国7月のISM非製造業景況指数  
 \*10年利付国債入札(24,000億円、8/7発行)  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、8/13借入)

<< 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 0.525 ▲ 0.005	日経平均株価(終値) 15,474.50 ▲ 48.61	為替(9時) 102.56-58 為替(5時) 102.58-59
----------------------------	---------------------------------	--------------------------------------

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	7/28	7/29	7/30	7/31	8/1	8/4
日銀当預残	1,485,600	1,513,700	1,526,800	1,520,600	1,527,700	1,482,800
準備預金残	1,360,600	1,386,900	1,389,700	1,389,500	1,399,900	1,356,700
レート	0.066%	0.066%	0.065%	0.065%	0.068%	0.067%
月中平均	0.06636%	0.06634%	0.06630%	0.06626%	0.06800%	0.06775%

8/1のマネタリーベース		2,439,500	
8/1コール合計	165,445	無担 66,425	有担 99,020
コール前日増減	計 ▲ 2,475	無担 ▲ 2,077	有担 ▲ 398

8/4の加重平均レート(速報)				8/1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		
0.055 ~0.135 (0.067)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N 0.060	~0.135 (0.068)		0.062	~0.120 (0.075)	0.030	~0.040 (0.031)
0.063 ~0.120 (0.069)						T/N						
						S/N						
0.117 ~0.400 (0.138)						1W		0.117	(0.117)			
0.118 (0.118)						2W		0.118	(0.118)			
						3W						
0.118 (0.118)				0.08-0.12	-	1M		0.090	~0.145 (0.114)		有担先日付分	
				0.08-0.12	-	2M						
0.117 (0.117)				0.08-0.12	0.0240	3M						
				-	-	6M						
				-	-	1Y						

## <<オペ情報、入札結果>>

国債買入 3,000億円	8/6	応札 14,035億円	落札 3,009億円	按分利回り較差 0.004%	81.4%	平均利回り較差 0.004%
国債買入 2,000億円	8/6	応札 12,222億円	落札 2,004億円	按分利回り較差 0.004%	49.2%	平均利回り較差 0.004%
国債買入 1,000億円	8/6	応札 3,392億円	落札 1,008億円	按分利回り較差 0.001%	14.1%	平均利回り較差 0.003%
国債買入 300億円	8/6	応札 1,701億円	落札 300億円	全取利回り較差 0.010%		平均利回り較差 0.011%
ETF買入 156億円	約定日 8/4					

「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