

<<資金需給>>

単位 億円

	22日需給速報		23日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	▲ 1,600	▲ 1,000
財政		3,200	0	▲ 7,000
資金過不足		2,900	▲ 1,600	▲ 8,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
65,743				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		25,000		
国庫短期証売却				
国債買入		11,900	4,800	
CP等買入		4,000		
		▲ 200	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援		3,241		1,100
				▲ 1,100
社債等買入			▲ 100	
ETF買入		300		
国債補完供給		100		
小計		41,100	4,500	0
当預増減		44,000	2,900	▲ 8,000

当座預金残高	2,265,100	7/22以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,046,100		53,700
積み終了先	1,700,200	7/23以降の残り所要積立額	
超過準備	1,699,200	積数	40,500
非準備先残高	219,000	1日平均	1,700
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)			2,021,900
準備預金進捗率	98.00% (実績)		22.58% (日数)

7/21のマナターベース		3,173,000	
7/21コール	合計	192,539	無担 57,380 有担 135,159
コール前日増減	計	▲ 3,140	無担 ▲ 5,030 有担 1,890

7/22の加重平均レート(速報)			7/21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
0.060 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.053 ~0.120 (0.077)				T/N	0.050 ~0.120 (0.075)	
				S/N		
0.064 ~0.340 (0.114)				1W	0.073 ~0.130 (0.116)	
				2W		
				3W		
		0.08-0.13	-	1M	0.170 (0.170)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.001	3M		
		-	-	6M		
		-	▲0.025-▲0.02	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

20年利付国債(表面利率1.3%) 応札3兆3,684億円 落札1兆892億円(I 非競争入札:1,100億円) 7/24~2035/6/20 1.188% 按分50.3938% 平均1.185%
 交付税特会 1兆500億円 7/30~2016/1/28 応札 2兆8,800億円 落札 1兆500億200万円 0.083% 按分 35.5560% 平均 0.081%
 ETF買入 324億円 約定日 7/22
 J-REIT買入 14億円 約定日 7/22

「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。」

<< 7/23の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,268,000	前日比	2,900
O/N	0.065~0.075	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.065~0.075%前後での出会いが中心になると見込まれる。

<< 22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4兆円増加の171兆6,000億円(当座預金残高見込みは226兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀・地銀・信託業態から0.06~0.075%近辺の調達希望が始まった。ほぼ昨日までと変わらない出会いで、立ち上がりは0.075%近辺の出会いが中心。まとまった金額の取引に関しては0.07%台後半の出会いも散見されたが、一巡後は取り下がり、0.07%前後の出会いで推移した。ターム物は、大手行から1Wの期間でまとまった調達が見られた。

<< 22日のオープン市場動向 >>
 短国現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国アウトライト市場では3M:▲0.001%、1Y:▲0.025~▲0.02%の出会いが見られた。CP市場は五・十日の前倒しで発行件数が増えたほか、精密機械・商社・化学等の業態から大型発行案件がみられ、償還総額1,300億円程度に対し、発行総額は2,200億円程度まで膨らんだ。発行レートは月内償還物を中心に小高い水準がみられたものの、概ね横ばい圏での取引となった。

<< 23日の材料 >>
 *6月の貿易統計
 *国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、7/27発行)

<<コール6月積み期間分の加重平均レート>>			
(土日を含む)	無担	0.07193%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07100%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	123.86-88
0.410 ▲ 0.006	20,593.67 ▲ 248.30	為替(5時)	123.74-75

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	7/14	7/15	7/16	7/17	7/21	7/22
日銀当預残	2,272,600	2,275,400	2,273,700	2,277,000	2,221,100	2,265,100
準備預金残	2,065,000	2,062,700	2,056,700	2,060,800	2,012,700	2,046,100
レート	0.076%	0.076%	0.075%	0.074%	0.076%	0.075%
月中平均	0.07414%	0.07427%	0.07431%	0.07425%	0.07433%	0.07436%

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