

**<<資金需給>>**

単位 億円

	23日需給速報		24日需給予想		27日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,700	▲ 1,100	▲ 1,000		
財政		0	▲ 4,600	▲ 13,000		
資金過不足		▲ 1,700	▲ 5,700	▲ 12,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					2,800	
65,743					▲ 2,600	
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		4,800			11,800	
CP等買入						
		▲ 200	▲ 500			
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836						
被災地支援			1,100			
3,241			▲ 1,100			
社債等買入		▲ 100	▲ 100			
ETF買入						
国債補充供給						
小計		4,500	▲ 600		12,000	
当預増減		2,800	▲ 6,300		0	

当座預金残高	2,267,900	7/23以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,054,600		40,500
積み終了先	1,713,400	7/24以降の残り所要積立額	
超過準備	1,712,500	積数	30,200
非準備先残高	213,300	1日平均	1,300
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	98.51% (実績)	25.81% (日数)	

7/22のマナターベース		3,217,200	
7/22コール	合計	206,487	無担 71,286 有担 135,201
コール前日増減	計	13,948	無担 13,906 有担 42

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	
0.055 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)		0.060 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.120 (0.077)				0.053 ~0.120 (0.077)		
0.117 (0.117)				0.064 ~0.340 (0.115)		
0.141 (0.141)		0.08-0.13				有担先日付分
		0.08-0.12				
0.080 (0.080)		0.08-0.12	▲0.003-▲0.002			
			▲0.045			
			▲0.072-▲0.028			

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	2,261,600	前日比	▲ 6,300
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%前後での出合いが中心になると見込まれる。

<< 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、前日比2,000億円増加の171兆8,000億円(当座預金残高見込みは226兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀・地銀・信託業態から0.06~0.075%近辺の調達希望で始まった。前日までほとんど変わらない地合いで、立ち上がりは0.075%近辺の出合いが中心。まとまった金額の取引に関しては0.07%台後半の出合いも散見されたが、一巡後は取り下がり、0.07%前後の出合いで推移した。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。共通担保資金供給オペは、3M8,000億円のオファーに対して、落札額2,841億円(期落ち分2,640億円)の札割れとなった。

<< 23日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は3M物の入札が実施され、按分落札レート▲0.002% (按分比率59.1778%)、平均落札レート▲0.0032%と引き続き堅調な結果となった。セカンダリーではほぼ事前予想通りの結果になったことから▲0.003~▲0.002%の出合いが散見されるにとどまった。その他には、短国買入オペの思惑からか、6M物が▲0.045%、1Y物が▲0.072%の出合いが見られた。CP市場は、鉄鋼・石油業態を中心にまとまった発行案件が見られ、償還総額600億円程度に対し、発行総額は2,100億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばいで推移した。

<< 24日の材料 >>  
 \*流動性供給入札(5,000億円、7/28発行)  
 \*米国6月の新築一戸建て販売件数

JGB新発10年債	0.410	0.000	日経平均株価(終値)	20,683.95	90.28	為替(9時)	124.05-07
						為替(5時)	123.78-80

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	7/21	7/22	7/23
日銀当預残	2,275,400	2,273,700	2,277,000	2,221,100	2,265,100	2,267,900
準備預金残	2,062,700	2,056,700	2,060,800	2,012,700	2,046,100	2,054,600
レート	0.076%	0.075%	0.074%	0.076%	0.075%	0.076%
月中平均	0.07427%	0.07431%	0.07425%	0.07433%	0.07436%	0.07443%

<< オペ情報、入札結果 >>

全店共通	8,000億円	7/27 ~ 10/26 (91日間) 応札	2,841億円	落札	2,841億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債買入	3,750億円	7/27 応札	14,819億円	落札	3,751億円	0.002%	50.0%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,250億円	7/27 応札	15,337億円	落札	4,254億円	0.006%	93.1%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	2,400億円	7/27 応札	7,302億円	落札	2,402億円	0.004%	70.0%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	1,400億円	7/27 応札	4,010億円	落札	1,403億円	-0.005%	43.3%	平均利回り較差	0.001%

T-Bill3M 応札22兆7,564億円 落札4兆6,933億1,000万円(非競争入札:3,866億円) 7/27~10/26 ▲0.0020% 按分59.1778% 平均▲0.0032%

「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録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