

<<資金需給>>

単位 億円

	27日需給速報		28日需給予想	29日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		300	▲ 100	0
財政		▲ 16,800	▲ 4,800	1,000
資金過不足		▲ 16,500	▲ 4,900	1,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		2,800		
65,944		▲ 2,600		
国債買現		0		
CP買現		0		
国庫短期証買入			20,000	
国庫短期証売却				
国債買入		12,200		4,200
CP等買入		▲ 400	▲ 300	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援		3,241		
社債等買入		▲ 100		
ETF買入				
国債補完供給				
小計		11,900	19,700	4,200
当預増減		▲ 4,600	14,800	5,200

当座預金残高	2,256,900	7/27以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,050,800		17,400
積み終了先	1,716,800	7/28以降の残り所要積立額	
超過準備	1,716,800	積数	14,800
非準備先残高	206,100	1日平均	800
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	99.27% (実績)	38.71% (日数)	

7/24のマナターベース				3,216,300
7/24コール	合計	211,609	無担	73,544
			有担	138,065
コール前日増減	計	2,790	無担	2,184
			有担	606

7/27の加重平均レート(速報)				7/24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		有担当日分
0.030 ~0.080 (0.075)	0.030	~0.040	(0.031)			0.055 ~0.080 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.050 ~0.120 (0.079)							0.050 ~0.120 (0.078)	
0.101 (0.101)						1W 0.117 (0.117)	0.069 ~0.130 (0.100)	
0.160 ~0.310 (0.193)						2W		
						3W		
0.170 ~0.260 (0.200)				0.08-0.13	-	1M	0.175 (0.175)	有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M		
				0.08-0.12	▲0.003	3M		
				-	-	6M		
				-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	4,000億円	7/29	応札	14,354億円	落札	4,004億円	按分利回り較差	-0.001%	28.0%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	200億円	7/29	応札	743億円	落札	201億円	按分価格較差	-0.100円	20.0%	平均価格較差	-0.296円
ETF買入	324億円	約定日	7/27								

「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

7/28の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,271,700	前日比	14,800
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。					

<< 27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5,000億円増加の172兆4,000億円(当座預金残高見込みは225兆7,000億円)。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。先週末とほぼ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、ロール案件の取引が中心となった。

<< 27日のオープン市場動向 >>
現先S/N物は低位横ばい圏で推移した。短国市場は特段の材料も無く閑散。3M物で▲0.003%の出合いが見られた程度であった。CP市場は、一部に大型の発行案件が見られたものの、発行総額は400億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。

- << 28日の材料 >>
- *米国FOMC(1日目)
 - *米国5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
 - *米国7月のCB消費者信頼感指数
 - *英国4-6月期のGDP速報値
 - *2年利付国債入札(25,000億円、8/17発行)

JGB新発10年債	0.406	0.001	日経平均株価(終値)	20,350.10	▲ 194.43	為替(9時)	123.76-77
						為替(5時)	123.28-30

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	7/17	7/21	7/22	7/23	7/24	7/27
日銀当預残	2,277,000	2,221,100	2,265,100	2,267,900	2,261,500	2,256,900
準備預金残	2,060,800	2,012,700	2,046,100	2,054,600	2,053,200	2,050,800
レート	0.074%	0.076%	0.075%	0.076%	0.076%	0.075%
月中平均	0.07425%	0.07433%	0.07436%	0.07443%	0.07462%	0.07463%

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