

<<資金需給>>

単位 億円

	28日需給速報		29日需給予想	30日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 100	▲ 700	0
財政		▲ 4,700	▲ 3,500	0
資金過不足		▲ 4,800	▲ 4,200	0
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
65,944				
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			4,300	
CP等買入				
		▲ 300	▲ 100	
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			100	
国債補完供給				
小計		19,700	4,200	0
当預増減		14,900	0	0

当座預金残高	2,271,800	7/28以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,068,500		14,800
積み終了先	1,741,700	7/29以降の残り所要積立額	
超過準備	1,741,700	積数	12,500
非準備先残高	203,300	1日平均	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	99.38% (実績)	41.94% (日数)	

7/27のマナターベース				3,211,400
7/27コール	合計	213,854	無担	75,576
			有担	138,278
コール前日増減	計	2,245	無担	2,032
			有担	213

7/28の加重平均レート(速報)				7/27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
0.060 ~0.125 (0.075)	0.030	~0.040 (0.031)				0.030 ~0.080 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.050 ~0.120 (0.078)							0.050 ~0.120 (0.079)	
0.073 ~0.140 (0.094)							0.101 ~0.130 (0.108)	
0.116 ~0.175 (0.146)							0.160 ~0.310 (0.193)	
				0.08-0.13	-			0.170 ~0.260 (0.200)
				0.08-0.12	-			
0.118 (0.118)				0.08-0.12	▲0.002			
				-	-			
				-	-			
				-	-			

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 12,000億円 7/28 ~ 7/29 (1日間) 応札 5億円 落札 5億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)
 CP買入 4,000億円 7/31 応札 10,426億円 落札 3,996億円 按分レート 0.085% 11.7% 平均落札レート 0.090%

米ドル資金供給(固定金利方式) 7/30~8/6 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.630%

2年利付国債(表面利率0.1%) 応札8兆7,776億円 落札2兆2,868億円(I非競争入札:2,123億円) 8/17~2017/8/15 0.007% 按分28.2977% 平均0.005%

ETF買入 324億円 約定日 7/28

J-REIT買入 14億円 約定日 7/28

7/29の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,271,800	前日比	0
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。

<< 28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2兆3,000億円増加の174兆7,000億円(当座預金残高見込みは227兆2,000億円)。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。各業態の調達水準は昨日とほぼ変わらず、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。

<< 28日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は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▲0.002%の出合いが散見された程度であった。CP市場は、機械・ノンバンク業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は2,600億円程度まで膨らんだ。発行レートは概ね横ばい圏での取引となったが、一部の銘柄では小幅上昇する動きが見られた。CP等買入オペが実施され、平均落札利回0.090%・按分落札利回0.085%と前回比上昇の結果となった。

<< 29日の材料 >>
 *6月の商業動態統計速報
 *米国FOMC(2日目)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、8/6借入)

JGB新発10年債	0.400	▲ 0.006	日経平均株価(終値)	20,328.89	▲ 21.21	為替(9時)	123.26-28
						為替(5時)	123.64-66

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	7/21	7/22	7/23	7/24	7/27	7/28
日銀当預残	2,221,100	2,265,100	2,267,900	2,261,500	2,256,900	2,271,800
準備預金残	2,012,700	2,046,100	2,054,600	2,053,200	2,050,800	2,068,500
レート	0.076%	0.075%	0.076%	0.076%	0.075%	0.075%
月中平均	0.07433%	0.07436%	0.07443%	0.07462%	0.07463%	0.07464%

「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