

《資金需給》

単位 億円

	29日需給速報		30日需給予想		31日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 700	▲ 600	▲ 1,200		
財政		▲ 3,800	▲ 600	20,300		
資金過不足		▲ 4,500	▲ 1,200	19,100		
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				
国庫短期証券買入						
国庫短期証券売却						
国債買入		4,300		11,800		
CP等買入				4,000		
貸出支援基金(成長)						
(増加)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
ETF買入		100				
国債補充供給						
小計		4,200	▲ 300	15,800		
当預増減		▲ 300	▲ 1,500	34,900		

7/30の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,270,000	前日比	▲ 1,500
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。					

《 29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7,000億円減少の174兆円(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。昨日と各業態の調達水準はほぼ同様で、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、閑散な地合いであった。

《 29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。短国市場は引き続き材料に乏しく閑散。3Mで▲0.002%の出合いが散見された程度であった。CP市場は、月末発行にかかり、幅広い業態から大型の発行案件が見られ、入札ベースでの発行総額は10,000億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。

《 30日の材料 》

- *石田日銀審議委員、京都府金融経済懇談会にて講演
- *6月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+0.3%)
- *米国4-6月期のGDP速報値
- *国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、8/3発行)

当座預金残高	2,271,500	7/29以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,060,700		12,500
積み終了先	1,736,000	7/30以降の残り所要積立額	
超過準備	1,736,000	積数	10,700
非準預先残高	210,800	1日平均	600
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	99.47%	(実績)	45.16%
		(日数)	

JGB新発10年債		日経平均株価(終値)		為替(9時)	123.57-59
0.400	0.000	20,302.91	▲ 25.98	為替(5時)	123.66-68

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	7/22	7/23	7/24	7/27	7/28	7/29
日銀当預残	2,265,100	2,267,900	2,261,500	2,256,900	2,271,800	2,271,500
準備預金残	2,046,100	2,054,600	2,053,200	2,050,800	2,068,500	2,060,700
レート	0.075%	0.076%	0.076%	0.075%	0.075%	0.074%
月中平均	0.07436%	0.07443%	0.07462%	0.07463%	0.07464%	0.07462%

7/28のマナターベース			3,226,400			
7/28コール	合計	210,918	無担	75,217	有担	135,701
コール前日増減	計	▲ 2,936	無担	▲ 359	有担	▲ 2,577

7/29の加重平均レート(速報)				7/28の加重平均レート(確報)				単位(%)	
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		無担先日付分		有担当日分	
0.020 ~0.085 (0.074)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.060 ~0.125 (0.075)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.050 ~0.120 (0.079)				T/N		0.050 ~0.120 (0.078)			
0.125 (0.125)				S/N					
0.070 ~0.122 (0.094)				1W		0.073 ~0.140 (0.094)			
0.160 (0.160)				2W		0.116 ~0.175 (0.146)			
				3W					
				1M					有担先日付分
		0.08-0.13	-	2M					
		0.08-0.12	-	3M		0.118 (0.118)			
		0.08-0.12	▲0.002	6M					
		-	-	1Y					

《オベ情報、入札結果》

国債買入	3,750億円	7/31	応札	14,727億円	落札	3,754億円	按分利回り較差	0.000%	24.8%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	4,250億円	7/31	応札	15,706億円	落札	4,256億円	按分利回り較差	0.003%	77.4%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	2,400億円	7/31	応札	7,766億円	落札	2,401億円	按分利回り較差	0.005%	76.1%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	1,400億円	7/31	応札	6,142億円	落札	1,402億円	按分利回り較差	0.007%	69.2%	平均利回り較差	0.008%
交付税特会	1兆500億円	8/6~2016/2/4	応札	3兆900億円	落札	1兆500億円	0.081%	按分95.4547%	平均0.081%		
ETF買入	324億円	約定日	7/29								
J-REIT買入	14億円	約定日	7/29								

「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