

**<<資金需給>>**

単位 億円

	30日需給速報		31日需給予想		3日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 800	▲ 600	▲ 600	▲ 2,000	
財政		▲ 600	18,900	▲ 33,000		
資金過不足		▲ 1,400	18,300	▲ 31,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)					1,100	
65,944					▲ 1,400	
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			12,100			
CP等買入			4,000			
		▲ 300	▲ 2,900			
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			▲ 200			
ETF買入			300			
国債補完供給						
小計		▲ 300	13,300	▲ 300		
当預増減		▲ 1,700	31,600	▲ 31,300		

当座預金残高	2,269,800	7/30以降の残り所要積立額	10,700
準備預金残高	2,053,100	7/31以降の残り所要積立額	9,200
積み終了先	1,726,500	積数	600
超過準備	1,726,500	1日平均	600
非準備預先残高	216,700		
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	2,020,700		
準備預金進捗率	99.54% (実績)	48.39% (日数)	

7/29のマネタリーベース		3,226,900	
7/29コール	合計	205,352	無担 73,058 有担 132,294
コール前日増減	計	▲ 5,566	無担 ▲ 2,159 有担 ▲ 3,407

7/30の加重平均レート(速報)			7/29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	
0.060 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)		0.020 ~0.085 (0.074)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.030 ~0.121 (0.067)				0.050 ~0.120 (0.079)		
0.100 (0.100)				0.077 ~0.125 (0.081)		
0.052 ~0.117 (0.113)				0.070 ~0.122 (0.094)		
0.114 (0.114)				0.160 (0.160)		
0.143 ~0.630 (0.248)		0.08-0.13				有担先日付分
		0.08-0.12				
		0.08-0.12	▲0.015-▲0.005			
		-				
		-				
		-				

7/31の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,301,400	前日比	31,600
O/N	0.06~0.07	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12

無担O/Nは0.06~0.07%前後での出合いが中心になると見込まれる。

**<< 30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1兆1,000億円減少の172兆9,000億円(当座預金残高見込みは227兆円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06~0.073%、地銀・信託業態から0.07~0.075%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは0.074%近辺の出合いが中心と、昨日までと比べて若干弱めの地合いとなった。一巡後も調達意欲は弱めで、まとまった金額の取引に関しては0.075%台近辺の出合いも散見されたが、0.06~0.07%近辺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。

**<< 30日のオープン市場動向 >>**  
 短国市場は3M物の入札が実施された。W I取引で▲0.005~▲0.007%と強めの出合いが見られたこともあり、落札結果は平均落札利回▲0.0044%、按分落札利回▲0.0040%と、ほぼ予想通りの結果となった。セカンダリー市場では▲0.005%から▲0.015%まで買い進まれた。CP市場は、鉄鋼・石油業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は1,500億円程度まで膨らんだ。発行レートは引き続き横ばい圏での推移となった。

**<< 31日の材料 >>**  
 \*6月の完全失業率(市場予想: 3.3%)  
 \*6月の有効求人倍率(市場予想: 1.20倍)  
 \*6月の全世帯家計調査(市場予想: 消費支出、前年比+1.7%)  
 \*6月全国・7月都区部消費者物価指数(CPI)  
 市場予想: 全 国(6月)前年同月比(除く生鮮): 0.0%  
 東京都区部(7月)前年同月比(除く生鮮): 0.0%  
 \*6月の住宅着工統計  
 \*米国7月のシカゴPM景況感指数  
 \*ユーロ圏7月の消費者物価指数速報値

JGB新発10年債	0.410	0.010	日経平均株価(終値)	20,522.83	219.92	為替(9時)	123.94-96
						為替(5時)	124.14-15

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	7/23	7/24	7/27	7/28	7/29	7/30
日銀当預残	2,267,900	2,261,500	2,256,900	2,271,800	2,271,500	2,269,800
準備預金残	2,054,600	2,053,200	2,050,800	2,068,500	2,060,700	2,053,100
レート	0.076%	0.076%	0.075%	0.075%	0.074%	0.075%
月中平均	0.07443%	0.07462%	0.07463%	0.07464%	0.07462%	0.07463%

**<< オペ情報、入札結果 >>**  
 全店共通 8,000億円 8/3 ~ 11/2 (91日間) 応札 1,065億円 落札 1,065億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 国債補完 8,316億円 7/30 ~ 7/31 (1日間) 応札 22億円 落札 22億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)  
 T-Bill3M 応札20兆50億円 落札4兆6,509億円(非競争入札:3,990億円) 8/3~11/2 ▲0.0040% 按分89.3386% 平均▲0.0044%

「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