

**<<資金需給>>**

単位 億円

	31日需給速報		3日需給予想 金額	4日当社予想 金額
	即日	金額		
銀行券		▲ 600	1,200	2,000
財政		18,200	▲ 33,500	▲ 50,000
資金過不足		17,600	▲ 32,300	▲ 48,000
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				
国庫短期買入				15,000
国庫短期証売却				
国債買入		12,100		12,000
CP等買入		4,000		
		▲ 2,900	▲ 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		▲ 200		
ETF買入		300		
国債補完供給				
小計		13,300	▲ 600	27,000
当預増減		30,900	▲ 32,900	▲ 21,000

当座預金残高	2,300,700	7/31以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,076,700		9,200
積み終了先	1,748,500	8/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,748,100	積数	5,900
非準備先残高	224,000	1日平均	500
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	2,021,100		
準備預金進捗率	99.71% (実績)	58.06% (日数)	

7/30のマナターベース		3,226,000	
7/30コール	合計	205,550	無担 73,832 有担 131,718
コール前日増減	計	198	無担 774 有担 ▲ 576

7/31の加重平均レート(速報)				7/30の加重平均レート(確報)					
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 ~0.075 (0.064)	0.030	~0.040 (0.031)					O/N	0.060 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)
0.050 ~0.120 (0.076)					T/N		0.030 ~0.121 (0.066)		
					S/N		0.100 (0.100)		
0.117 ~0.130 (0.117)					1W		0.052 ~0.117 (0.113)		
0.310 (0.310)					2W		0.114 (0.114)		
					3W				
				0.08-0.13	-	1M	0.143 ~0.630 (0.248)	有担先日付分	
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	-	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完	4,000億円	7/31	~ 8/3 (3日間)	応札	2億円	落札	2億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)	
国短買入	15,000億円	8/4		応札	30,911億円	落札	15,002億円	按分利回り較差	0.006%	81.2%	平均利回り較差	0.006%
国債買入	3,750億円	8/4		応札	14,425億円	落札	3,751億円	按分利回り較差	0.000%	69.7%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	4,250億円	8/4		応札	13,826億円	落札	4,255億円	按分利回り較差	0.001%	52.0%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	8/4		応札	18,491億円	落札	4,013億円	按分利回り較差	0.003%	42.9%	平均利回り較差	0.005%

「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

<< 8/3の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,267,800	前日比	▲ 32,900
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。					

**<< 31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3兆円増加の175兆9,000億円(当座預金残高見込みは230兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀から0.06%近辺、地銀・信託業態から0.06~0.065%近辺の調達希望が始まった。立ち上がりは0.065%近辺の出合いが中心。一日を通して調達意欲は弱く、まとまった金額の取引に関しては0.065~0.07%近辺の出合いも散見されたが、一巡後も0.06%台前半の出合いを中心に推移した。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。

**<< 31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。短国市場は動意に乏しく閑散。短国買入オペが15,000億円で実施され、平均利回較差・按分利回較差共に+0.006%と、引け値の低い銘柄を中心に応札されたとみられる小甘い結果となった。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600億円程度にとどまった。発行レートは、9月末越えの期日物で小幅ながら低下する動きが見られた。

**<< 3日の材料 >>**

- \*7月実績/8月見込み財政資金対民間収支
- \*米国6月の建設支出
- \*米国6月の個人所得・消費支出
- \*米国7月のISM製造業景況指数

**<<コール7月の加重平均レート>>**

(土日を含む)	無担	0.07429%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07395%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	0.405	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	20,585.24	62.41	為替(9時)	124.08-09
						為替(5時)	124.21-23

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	7/24	7/27	7/28	7/29	7/30	7/31
日銀当預残	2,261,500	2,256,900	2,271,800	2,271,500	2,269,800	2,300,700
準備預金残	2,053,200	2,050,800	2,068,500	2,060,700	2,053,100	2,076,700
レート	0.076%	0.075%	0.075%	0.074%	0.075%	0.064%
月中平均	0.07462%	0.07463%	0.07464%	0.07462%	0.07463%	0.07429%

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。