

<<資金需給>>

単位 億円

	3日需給速報		4日需給予想	5日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,200	500	1,000
財政		▲ 35,900	▲ 58,000	1,000
資金過不足		▲ 34,700	▲ 57,500	2,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		1,100		
65,649		▲ 1,400		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			15,000	
国庫短期証売却				
国債買入			12,000	4,500
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				
ETF買入				
国債補完供給				
小計		▲ 600	26,900	4,500
当預増減		▲ 35,300	▲ 30,600	6,500

当座預金残高	2,265,400	8/3以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,060,100		5,900
積み終了先	1,734,200	8/4以降の残り所要積立額	
超過準備	1,734,100	積数	4,900
非準備先残高	205,300	1日平均	400
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	99.76% (実績)	61.29% (日数)	

7/31のマネタリーベース		3,257,400	
7/31コール	合計	194,227	無担 62,825 有担 131,402
コール前日増減	計	▲ 11,323	無担 ▲ 11,007 有担 ▲ 316

8/3の加重平均レート(速報)				7/31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
0.060 ~0.125 (0.074)	0.030	~0.040 (0.031)		0.060 ~0.075 (0.064)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.068 ~0.120 (0.081)						0.050 ~0.120 (0.076)		
0.059 ~0.117 (0.106)						0.117 ~0.130 (0.117)		
0.340 (0.340)						0.310 (0.310)		
		0.08-0.13	-					有担先日付分
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	-					
		-	-					
		-	-					

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	700億円	8/5	応札	2,302億円	落札	700億円	按分利回り較差	0.002%	83.9%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	2,400億円	8/5	応札	8,593億円	落札	2,408億円	按分利回り較差	0.007%	48.8%	平均利回り較差	0.009%
国債買入	1,400億円	8/5	応札	4,765億円	落札	1,404億円	按分利回り較差	0.003%	95.0%	平均利回り較差	0.007%
ETF買入	324億円	約定日	8/3								

<< 8/4の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,234,800	前日比	▲ 30,600
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。					

<< 3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2兆7,000億円減少の173兆2,000億円(当座預金残高見込みは226兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託より0.06~0.065%近辺の調達希望で始まったものの、調達側がレートを切り上げたことで、立ち上がりは0.07~0.075%を挟んだ出合いが中心となった。一巡後も概ね同水準での出合いとなり、出合い水準は7月末より上昇した。ターム物は、証券系の調達が数件見られた程度であった。

<< 3日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばい圏で推移した。短国市場は動意に乏しく、全般的に閑散であった。CP市場は、ノンバンク等によるまとまった発行もあり、総額1,000億円程度の出合いがみられた。発行レートは引続き横ばいで推移した。

<< 4日の材料 >>
 *6月の毎月勤労統計調査速報
 *7月のマネタリーベース
 *8月の日銀当座預金増減要因見込み
 *米国6月の製造業新規受注・出荷・在庫
 *10年利付国債入札(24,000億円、8/6発行)
 *交付税特別会計借入(10,500億円、8/12借入)

<<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	0.410	0.005	日経平均株価(終値)	20,548.11	▲ 37.13	為替(9時)	124.04-06
						為替(5時)	124.17-19

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	7/27	7/28	7/29	7/30	7/31	8/3
日銀当預残	2,256,900	2,271,800	2,271,500	2,269,800	2,300,700	2,265,400
準備預金残	2,050,800	2,068,500	2,060,700	2,053,100	2,076,700	2,060,100
レート	0.075%	0.075%	0.074%	0.075%	0.064%	0.074%
月中平均	0.07463%	0.07464%	0.07462%	0.07463%	0.07429%	0.06733%

「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