

2015/8/4(火) <<セントラル短資株式会社>>

**<<資金需給>>**

単位 億円

|                                       | 4日需給速報 |          | 5日需給予想 |          | 6日当社予想 |    |
|---------------------------------------|--------|----------|--------|----------|--------|----|
|                                       | 即日     | 金額       | 金額     | 金額       | 金額     | 金額 |
| 銀行券                                   |        | 700      | 600    | 0        |        |    |
| 財政                                    |        | ▲ 58,400 | 3,800  | ▲ 25,000 |        |    |
| 資金過不足                                 |        | ▲ 57,700 | 4,400  | ▲ 25,000 |        |    |
| <b>貸出</b>                             |        |          |        |          |        |    |
| 売出手形                                  |        | 0        |        |          |        |    |
| 本店共通                                  |        | 0        |        |          |        |    |
| 全店共通                                  |        | 0        |        |          |        |    |
| 共通(固定)                                |        | 65,649   |        |          |        |    |
| 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   | 4,700  |          |        |    |
| CP等買入                                 |        | ▲ 100    | ▲ 200  |          |        |    |
| 貸出支援基金<br>(成長) 48,511<br>(増加) 244,836 |        |          |        |          |        |    |
| 被災地支援                                 |        | 3,241    |        |          |        |    |
| 社債等買入                                 |        |          | ▲ 100  |          |        |    |
| ETF買入                                 |        |          |        |          |        |    |
| 国債補完供給                                |        |          |        |          |        |    |
| 小計                                    |        | 26,900   | 4,400  | 0        |        |    |
| 当増減                                   |        | ▲ 30,800 | 8,800  | ▲ 25,000 |        |    |

| 8/5の日銀調節とレート予想 |             |        |           |     |           |
|----------------|-------------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節           | 見送り         | 当座預金残高 | 2,243,400 | 前日比 | 8,800     |
| 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。

<< 4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2兆8,000億円減少の170兆4,000億円(当座預金残高見込みは223兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託より0.07%近辺の調達希望で始まった。立ち上がりは前日より小幅上昇基調で、0.075%を挟んだ出合いが中心であった。一巡後は取り下がり、0.07%近辺で推移した。ターム物はロール案件が中心であった。

<< 4日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは小幅上昇した。短国市場は特段出合いが見られず、閑散であった。CP市場も入札件数・発行額共に少なく閑散。発行レートは概ね横ばいで推移した。

<< 5日の材料 >>  
 \*米国6月の貿易収支  
 \*米国7月のISM非製造業景況指数  
 \*MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)  
 \*国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、8/10発行)

| 8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% |

|                           |             |               |       |
|---------------------------|-------------|---------------|-------|
| 当座預金残高                    | 2,234,600   | 8/4以降の残り所要積立額 |       |
| 準備預金残高                    | 2,030,800   |               | 4,900 |
| 積み終了先                     | 1,702,800   | 8/5以降の残り所要積立額 |       |
| 超過準備                      | 1,702,800   | 積数            | 4,300 |
| 非準預先残高                    | 203,800     | 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                   | 99.79% (実績) | 64.52%        | (日数)  |

|           |       |         |            |           |         |        |           |
|-----------|-------|---------|------------|-----------|---------|--------|-----------|
| JGB新発10年債 | 0.385 | ▲ 0.025 | 日経平均株価(終値) | 20,520.36 | ▲ 27.75 | 為替(9時) | 123.94-96 |
|           |       |         |            |           |         | 為替(5時) | 123.85-87 |

| 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                             | 7/28      | 7/29      | 7/30      | 7/31      | 8/3       | 8/4       |
| 日銀当座預金                         | 2,271,800 | 2,271,500 | 2,269,800 | 2,300,700 | 2,265,400 | 2,234,600 |
| 準備預金残                          | 2,068,500 | 2,060,700 | 2,053,100 | 2,076,700 | 2,060,100 | 2,030,800 |
| レート                            | 0.075%    | 0.074%    | 0.075%    | 0.064%    | 0.074%    | 0.076%    |
| 月中平均                           | 0.07464%  | 0.07462%  | 0.07463%  | 0.07429%  | 0.06733%  | 0.06950%  |

| 8/3のマナタリーベース |         |       |         |
|--------------|---------|-------|---------|
| 8/3コール合計     | 201,298 | 無担    | 71,956  |
| 有担           | 129,342 |       |         |
| コール前日増減      | 計       | 7,071 | 無担      |
| 有担           | 9,131   | 有担    | ▲ 2,060 |

| 8/4の加重平均レート(速報) |                       |        |                       | 8/3の加重平均レート(確報) |    |     |                       | 単位(%)                 |                       |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------------------|-----------------|----|-----|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 無担(平均)          | 0.060 ~ 0.125 (0.076) | 有担(平均) | 0.030 ~ 0.040 (0.031) | CP気配a-1         | 短国 | O/N | 0.060 ~ 0.125 (0.074) | 有担当日分                 | 0.030 ~ 0.040 (0.031) |
|                 | 0.068 ~ 0.130 (0.082) |        |                       |                 |    | T/N |                       | 0.068 ~ 0.120 (0.081) |                       |
|                 | 0.064 ~ 0.140 (0.097) |        |                       |                 |    | S/N |                       |                       |                       |
|                 |                       |        |                       |                 |    | 1W  | 0.117 (0.117)         | 0.059 ~ 0.074 (0.067) |                       |
|                 |                       |        |                       |                 |    | 2W  |                       | 0.340 (0.340)         |                       |
|                 |                       |        |                       |                 |    | 3W  |                       |                       |                       |
|                 |                       |        |                       | 0.08-0.13       | -  | 1M  |                       |                       | 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 8,000億円 8/4 ~ 8/5 (1日間) 応札 5億円 落札 5億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)  
 米ドル資金供給(固定金利方式) 8/6~8/13 (7日間) 応札 100万ドル 落札 100万ドル 貸付利率 0.640%  
 10年利付国債(表面利率0.4%) 応札6兆2,345億円 落札2兆1,919億円(I非競争入札:2,048億円) 8/6~2025/6/20 0.404% 按分7.7122% 平均0.400%  
 交付税特会 1兆500億円 8/12~2016/2/9 応札 3兆3,925億円 落札 1兆500億円 0.080% 按分45.2834% 平均0.079%

「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