

<<資金需給>>

単位 億円

	6日需給速報		7日需給予想	10日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 400	▲ 600	1,000
財政		▲ 26,400	2,000	▲ 30,000
資金過不足		▲ 26,800	1,400	▲ 29,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,400
65,649				▲ 1,600
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				
		▲ 400	▲ 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				
ETF買入		200		
国債補完供給				
小計		▲ 200	11,800	800
当預増減		▲ 27,000	13,200	▲ 28,200

当座預金残高	2,216,500	8/6以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,016,400		3,700
積み終了先	1,689,300	8/7以降の残り所要積立額	
超過準備	1,689,300	積数	3,100
非準備先残高	200,100	1日平均	300
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	99.85% (実績)	70.97% (日数)	

8/5のマネタリーベース		3,197,700	
8/5コール	合計	205,580	無担 77,631 有担 127,949
コール前日増減	計	▲ 345	無担 478 有担 ▲ 823

8/6の加重平均レート(速報)			8/5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	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.059 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.078)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.068 ~0.120 (0.080)				T/N	0.069 ~0.120 (0.079)	
				S/N		
0.117 (0.117)				1W	0.052 ~0.122 (0.076)	
0.110 (0.110)				2W	0.170 (0.170)	
				3W		
		0.08-0.13	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.015-▲0.002	3M		
		-	▲0.070-▲0.055	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	8/10 ~ 11/9 (91日間)	応札 2,381億円	落札 2,381億円	0.100%	全取	平均 0.100% (固定)
国債補完	12,000億円	8/6 ~ 8/7 (1日間)	応札 16億円	落札 16億円	-0.400%	全取	平均 -0.400% (即)
CP買入	3,500億円	8/11	応札 8,495億円	落札 3,486億円	按分レート 0.085%	14.5%	平均落札レート 0.087%
T-Bill3M	応札21兆1,623億円	落札4兆6,256億3,000万円(非競争入札:4,243億円)	8/10~11/9	▲0.0040%	按分43.4472%	平均▲0.0052%	
流動性供給	応札 5,863億円	落札 2,999億円	8/10	募入最大利回較差 0.026%	按分 6.6666%	募入平均利回較差 0.013%	
交付税特会	1兆500億円	8/14~2016/2/12	応札 3兆3,207億円	落札1兆500億円	0.079%	按分6.2260%	平均0.077%
J-REIT買入	13億円	約定日 8/6					

<< 8/7の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,229,700	前日比	13,200
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。					

<< 6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2兆4,000億円減少の168兆9,000億円(当座預金残高見込みは221兆6,000億円)。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り、立ち上がりは0.075%を挟んだ出合いが中心となった。0.07%台後半ではまとまった金額の出合いが複数見られた。一巡後も同水準の出合いであった。ターム物は引き続き閑散とした取引であった。

<< 6日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばい圏での推移となった。短国市場は3M物の入札が実施された。WI取引で▲0.006~▲0.004%と強めの出合いが見られる中、平均落札利回り▲0.0052%、最高落札利回り▲0.0040%と事前予想よりやや強めの結果となった。セカンダリーはショートカバーから一部で▲0.015%の出合いも見られたが、その後は売り買いが交錯し、引け際には▲0.002%の出合いが見られた。CP市場は10日発行にあたったことで、通信、食料品等の業態でまとまった発行が見られ、発行総額は2,000億円程度に膨らんだ。発行レートは概ね横ばいであった。

<< 7日の材料 >>
 *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
 *黒田日銀総裁、定例会見
 *7月のマネタリーベースと日本銀行の取引
 *米国6月の消費者信用残高
 *米国7月の雇用統計

<<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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	124.77-79
0.420	0.025	20,664.44	50.38
		為替(5時)	124.88-89

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	7/30	7/31	8/3	8/4	8/5	8/6
日銀当預残	2,269,800	2,300,700	2,265,400	2,234,600	2,243,500	2,216,500
準備預金残	2,053,100	2,076,700	2,060,100	2,030,800	2,039,900	2,016,400
レート	0.075%	0.064%	0.074%	0.076%	0.078%	0.076%
月中平均	0.07463%	0.07429%	0.06733%	0.06950%	0.07120%	0.07200%

「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録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