

<<資金需給>>

単位 億円

	7日需給速報		10日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 500	900	0
財政		1,900	▲ 31,300	1,000
資金過不足		1,400	▲ 30,400	1,000
貸出				
売出手形				
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				3,500
		▲ 300	▲ 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			100	
国債補充供給				
小計		11,800	600	3,500
当預増減		13,200	▲ 29,800	4,500

当座預金残高	2,229,700	8/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,028,200		3,100
積み終了先	1,703,000	8/10以降の残り所要積立額	
超過準備	1,702,600	積数	900
非準備先残高	201,500	1日平均	200
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	2,028,300		
準備預金進捗率	99.96% (実績)	80.65% (日数)	

8/6のマネタリーベース		3,171,100	
8/6コール 合計	204,103 無担	74,935 有担	129,168
コール前日増減 計	▲ 1,477 無担	▲ 2,696 有担	1,219

8/7の加重平均レート(速報)				8/6の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N	0.059 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.068 ~0.120 (0.083)				T/N		0.068 ~0.120 (0.080)	
				S/N			
0.064 ~0.120 (0.113)				1W		0.117 (0.117)	
0.118 (0.118)				2W		0.110 (0.110)	
0.118 (0.118)				3W			
				1M			
		0.08-0.13	-	2M			
		0.08-0.12	-	3M			
		0.08-0.12	▲0.005-▲0.004	6M			
		-	▲0.080-▲0.055	1Y			
		-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

国債補完 4,000億円 8/7 ~ 8/10 (3日間) 応札 2億円 落札 2億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)

ETF買入 337億円 約定日 8/7

J-REIT買入 13億円 約定日 8/7

<<日銀金融政策決定会合結果>>

- ・マネタリーベースが、年間約80兆円に相当するペースで増加するよう金融市場調節を行う。(賛成8反対1)
- ・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。(賛成8反対1)
 - ①長期国債について、保有残高が年間約80兆円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。ただし、イールドカーブ全体の金利低下を促す観点から、金融市場の状況に応じて柔軟に運営する。買入れの平均残存期間は7年~10年程度とする。
 - ②ETFおよびJ-REITについて、保有残高がそれぞれ年間約3兆円、年間約900億円に相当するペースで増加するよう買入れを行う。
 - ③CP等、社債等について、それぞれ約2.2兆円、約3.2兆円の残高を維持する。

<<2016年の金融政策決定会合の日程>>

1/28(木)・29(金)、3/14(月)・15(火)、4/27(水)・28(木)、6/15(水)・16(木)、7/28(木)・29(金)、9/20(火)・21(水)、10/31(月)・11/1(火)、12/19(月)・20(火)

8/10の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,199,900	前日比	▲ 29,800
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。

<< 7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1兆6,000億円増加の170兆5,000億円(当座預金残高見込みは223兆円)。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。週末となったものの調達姿勢に変化は見られず、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、大手行から3Wの期間でまとまった調達が見られた。金融政策決定会合では金融調節方針の現状維持が決定された。

<< 7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。短国市場は全般的に閑散な中、短国買入オペを睨んでか、引け際に6Mで▲0.080~▲0.055%の出合いが見られた程度であった。CP市場は入札件数・発行額共に少なく、発行総額700億円程度の出合いと閑散であった。

<< 10日の材料 >>

- *金融経済月報
- *6月の国際収支
- *6月の特定サービス産業動態統計速報
- *7月の消費動向調査
- *7月の景気ウォッチャー調査
- *米国7月のFRB労働市場情勢指数

JGB新発10年債	0.415	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	20,724.56	60.12	為替(9時)	124.75-77
						為替(5時)	124.78-80

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	7/31	8/3	8/4	8/5	8/6	8/7
日銀当預残	2,300,700	2,265,400	2,234,600	2,243,500	2,216,500	2,229,700
準備預金残	2,076,700	2,060,100	2,030,800	2,039,900	2,016,400	2,028,200
レート	0.064%	0.074%	0.076%	0.078%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07429%	0.06733%	0.06950%	0.07120%	0.07200%	0.07333%

「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