

<<資金需給>>

単位 億円

	10日需給速報		11日需給予想		12日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		700		500		0
財政		▲ 31,100		4,900		▲ 5,000
資金過不足		▲ 30,400		5,400		▲ 5,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		2,400				
66,430		▲ 1,600				
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入						17,500
国庫短期証売却						
国債買入						12,000
CP等買入				3,500		
		▲ 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		100		800		
国債補完供給						
小計		600		4,200		29,500
当預増減		▲ 29,800		9,600		24,500

当座預金残高	2,199,900	8/10以降の残り所要積立額	900
準備預金残高	2,000,000	8/11以降の残り所要積立額	800
積み終了先	1,676,000	積数	200
超過準備	1,676,000	1日平均	200
非準備先残高	199,900		
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)	83.87% (日数)	

8/7のマネタリーベース		3,184,800	
8/7コール	合計	201,537	無担 71,690 有担 129,847
コール前日増減	計	▲ 2,566	無担 ▲ 3,245 有担 679

8/10の加重平均レート(速報)			8/7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
0.050 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.076)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.130 (0.083)				T/N	0.068 ~0.120 (0.083)	
				S/N		
0.110 ~0.125 (0.117)				1W 0.117 (0.117)	0.064 ~0.120 (0.097)	
0.118 ~0.310 (0.150)				2W	0.118 (0.118)	
0.118 (0.118)				3W	0.118 (0.118)	
		0.08-0.13	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.009-▲0.006	3M		
		-	▲0.08-▲0.042	6M		
		-	-	1Y		

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	17,500億円	8/12	応札	42,117億円	落札	17,500億円	按分利回り較差	0.011%	93.7%	平均利回り較差	0.015%
国債買入	3,750億円	8/12	応札	13,607億円	落札	3,751億円	按分利回り較差	0.001%	50.0%	平均利回り較差	0.003%
国債買入	4,250億円	8/12	応札	19,887億円	落札	4,256億円	按分利回り較差	-0.002%	16.1%	平均利回り較差	0.000%
国債買入	4,000億円	8/12	応札	15,491億円	落札	4,014億円	按分利回り較差	-0.017%	34.9%	平均利回り較差	-0.015%

<< 8/11の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,209,500	前日比	9,600
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。

<< 10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168兆1,000億円(当座預金残高見込みは220兆円)。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り、立ち上がりは0.075%を挟んだ出合いが中心となった。一巡後は0.07%台で幅広い出合いが見られた。ターム物は、ロール案件も含め複数の証券業態から調達が見られた。

<< 10日のオープン市場動向 >>

現先S/N物は横ばい圏で推移。短国市場では短国買入オペが実施された。落札結果は、平均落札利回り較差+0.015% 按分落札利回り較差+0.011%となり、引け値が低い銘柄を中心に応札されたと見られる結果になった。CP市場は償還総額1,200億円程度に対し、発行総額は600億円程度にとどまった。月内物が中心となったことで、発行レートは小幅上昇した。

<< 11日の材料 >>

- *7月のマネーストック
- *米国6月の卸売売上高
- *30年利付国債入札(8,000億円、8/13発行)

JGB新発10年債	0.400	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	20,808.69	84.13	為替(9時)	124.33-35
						為替(5時)	124.50-52

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	8/3	8/4	8/5	8/6	8/7	8/10
日銀当預残	2,265,400	2,234,600	2,243,500	2,216,500	2,229,700	2,199,900
準備預金残	2,060,100	2,030,800	2,039,900	2,016,400	2,028,200	2,000,000
レート	0.074%	0.076%	0.078%	0.076%	0.076%	0.075%
月中平均	0.06733%	0.06950%	0.07120%	0.07200%	0.07333%	0.07350%

「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