

◀資金需給▶

単位 億円

| | 5日需給速報 | | 6日需給予想 | 7日当社予想 |
|---------------------------|-----------|---------------|---------|------------|
| | 即日 | 金額 | 金額 | 金額 |
| 銀行券 | | 1,000 | 700 | 0 |
| 財政 | | 6,400 | ▲ 1,300 | ▲ 24,000 |
| 資金過不足 | | 7,400 | ▲ 600 | ▲ 24,000 |
| 貸出 | | | | |
| 売出手形 | | | | |
| 0 | | | | |
| 本店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 全店共通 | | | | |
| 0 | | | | |
| 共通(固定) | | | | |
| 105,038 | | | | |
| 国債買現 | | | | |
| 0 | | | | |
| CP買現 | | | | |
| 0 | | | | |
| 国庫短期証買入 | | 30,000 | | |
| 国庫短期証売却 | | | | |
| 国債買入 | | 5,100 | 6,400 | |
| CP等買入 | | ▲ 500 | ▲ 100 | |
| 貸出支援基金(成長) | | | | |
| 34,837(増加) 133,488 | | | | |
| 被災地支援 | | | | |
| 3,623 | | | | |
| 社債等買入 | | | | |
| ETF買入 | | | 100 | |
| 国債補完供給 | | | | |
| 小計 | | 34,600 | 6,400 | 0 |
| 当預増減 | | 42,000 | 5,800 | ▲ 24,000 |
| 当座預金残高 | 1,524,800 | 8/5以降の残り所要積立額 | | |
| 準備預金残高 | 1,399,600 | | | 13,100 |
| 積み終了先 | 1,188,100 | 8/6以降の残り所要積立額 | | |
| 超過準備 | 1,187,500 | | | 積数 11,000 |
| 非準備先残高 | 125,200 | | | 1日平均 1,100 |
| 積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数) | | | | 1,905,400 |
| 準備預金進捗率 | 99.42% | (実績) | 67.74% | (日数) |

| ◀ 8/6の日銀調節とレート予想 ▶ | | | | | |
|--------------------|-----------|--------|-----------|-----|-----------|
| 日銀調節 | 見送り | 当座預金残高 | 1,530,600 | 前日比 | 5,800 |
| O/N | 0.06~0.07 | T/N | 0.06~0.12 | S/N | 0.06~0.12 |

無担O/Nは0.06~0.065%中心の取引となろう。

◀ 5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4兆6,000億円増加の119兆1,000億円(当座預金残高見込みは152兆5,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.061~0.064%、大手行から0.06%付近でのビッドと、昨日に引続き、落ち着いた立ち上がりとなった。その後、一部邦銀から試し取りと思われるビッドが入り、0.125%での出合いが見られた。その他の出合いは、0.061~0.063%中心に推移した。午後の出合いは調整程度で、一日の取引を終えた。ターム物については、大手行が1W物0.117%、2W・1M物0.118%での調達を行った。

◀ 5日のオープン市場動向 ▶
 現先レートS/Nは前日比で低下した。短国市場は、明日に入札を控えて様子見の展開が続いており、3M0.021~0.023%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、総額1,200億円程度の出合いにとどまった。発行レートは概ね横ばいで推移した。CP等買入オペは前回比500億円増額の4,500億円で実施された。応札可能な銘柄が多かったこともあり、按分落札利回0.092%と前回比で上昇した。

- ◀ 6日の材料 ▶
- *6月の景気動向指数速報
 - *MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
 - *米国6月の貿易収支
 - *国庫短期証券入札(6ヶ月、35,000億円、8/11発行)

| ◀コール7月の加重平均レート▶ | | | |
|-----------------|----|----------|-------------|
| (土日を含む) | 無担 | 0.06626% | 有担 0.03397% |
| (営業日のみ) | 無担 | 0.06582% | 有担 0.03427% |

| JGB新発10年債 | 日経平均株価(終値) | 為替(9時) | 102.54-56 |
|---------------|--------------------|--------|-----------|
| 0.515 ▲ 0.010 | 15,320.31 ▲ 154.19 | 為替(5時) | 102.57-58 |

| 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 | 7/29 | 7/30 | 7/31 | 8/1 | 8/4 | 8/5 |
| 日銀当預残 | 1,513,700 | 1,526,800 | 1,520,600 | 1,527,700 | 1,482,800 | 1,524,800 |
| 準備預金残 | 1,386,900 | 1,389,700 | 1,389,500 | 1,399,900 | 1,356,700 | 1,399,600 |
| レート | 0.066% | 0.065% | 0.065% | 0.068% | 0.067% | 0.072% |
| 月中平均 | 0.06634% | 0.06630% | 0.06626% | 0.06800% | 0.06775% | 0.06860% |

| 8/4のマネタリーベース | | 2,393,300 | |
|--------------|---------|-----------|---------|
| 8/4コール合計 | 165,129 | 無担 | 67,939 |
| 有担 | 97,190 | | |
| コール前日増減 | 計 ▲ 316 | 無担 | 1,514 |
| | | 有担 | ▲ 1,830 |

| 8/5の加重平均レート(速報) | | | | 8/4の加重平均レート(確報) | | | | 単位(%) |
|----------------------|----------------------|-----------|-------------|--------------------------|----------------------|----------------------|--|-------|
| 無担(平均) | 有担(平均) | CP配a-1 | 短国 | 無担当日分 | 無担先日付分 | 有担当日分 | | |
| 0.045 ~0.135 (0.072) | 0.030 ~0.040 (0.031) | | | O/N 0.055 ~0.135 (0.067) | | 0.030 ~0.040 (0.031) | | |
| 0.062 ~0.130 (0.080) | | | | T/N | 0.063 ~0.120 (0.069) | | | |
| | | | | S/N | | | | |
| 0.071 ~0.200 (0.099) | | | | 1W 0.117 (0.117) | 0.117 ~0.400 (0.138) | | | |
| 0.115 (0.115) | | | | 2W | 0.118 (0.118) | | | |
| 0.116 (0.116) | | | | 3W | | | | |
| 0.118 (0.118) | | 0.08-0.12 | - | 1M | 0.118 (0.118) | 有担先日付分 | | |
| | | 0.08-0.12 | - | 2M | | | | |
| | | 0.08-0.12 | 0.021-0.023 | 3M | 0.117 (0.117) | | | |
| | | - | - | 6M | 0.150 (0.150) | | | |
| | | - | - | 1Y | | | | |

◀オペ情報、入札結果▶

国債補完 2,000億円 8/5 ~ 8/6 (1日間) 応札 1億円 落札 1億円 -0.400% 全取 平均 -0.400%(即)
 CP買入 4,500億円 8/8 応札 12,475億円 落札 4,268億円 按分レート 0.092% 54.5% 平均落札レート 0.093%

米ドル資金供給(固定金利方式) 8/7~8/14 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.590%

10年利付国債(表面利率0.6%) 応札9兆3,374億円 落札2兆1,781億円(I非競争入札:2,175億円) 8/7~2024/6/20 0.523% 按分21.6301% 平均0.522%

交付税特会 1兆500億円 8/13~2015/2/12 応札 3兆128億円 落札 1兆500億円 0.100% 按分 11.9356% 平均 0.098%

ETF買入 156億円 約定日 8/5

「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