

<<資金需給>>

単位 億円

	7日需給速報		8日需給予想	11日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	▲ 700	1,000
財政		▲ 26,700	2,300	▲ 38,000
資金過不足		▲ 27,000	1,600	▲ 37,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				4,000
105,038				▲ 5,000
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			5,500	
CP等買入		▲ 600	▲ 400	
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		▲ 200		
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		▲ 700	9,500	▲ 1,000
当預増減		▲ 27,700	11,100	▲ 38,000

当座預金残高	1,503,000	8/7以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,375,800		9,300
積み終了先	1,165,100	8/8以降の残り所要積立額	
超過準備	1,159,900	積数	8,000
非準預先残高	127,200	1日平均	1,000
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)			1,911,300
準備預金進捗率	99.58%	(実績)	74.19% (日数)

8/6のマネタリーベース				2,439,400
8/6コール	合計	160,680	無担	66,402
			有担	94,278
コール前日増減	計	▲ 4,036	無担	▲ 1,871
			有担	▲ 2,165

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)		CP配a-1	短国	無担当日分		無担先日付分		有担当日分	
0.058	~0.135 (0.070)	0.030	~0.040 (0.031)			0.045	~0.135 (0.069)			0.030	~0.040 (0.031)
0.067	~0.120 (0.080)							0.062	~0.120 (0.072)		
0.117	~0.255 (0.138)							0.117	~0.130 (0.124)		
0.118	~0.340 (0.126)							0.116	~0.170 (0.135)		
0.118	(0.118)										
0.116	~0.260 (0.120)			0.08-0.12	-	1M		0.118	~0.200 (0.119)		有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M		0.121	(0.121)		
				0.08-0.12	0.02-0.028	3M					
				-	-	6M					
				-	-	1Y					

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 8/11 ~ 11/10 (91日間) 応札 4,040億円 落札 4,040億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札29兆352億円 落札5兆2,390億円(非競争入札:4,809億5,000万円) 8/11~11/10 0.0280% 按分16.4550% 平均0.0236%
 流動性供給 応札 9,275億円 落札 2,982億円 8/11 募入最大利回較差 ▲0.003% 按分 29.9578% 募入平均利回較差 ▲0.006%
 ETF買入 156億円 約定日 8/7
 J-REIT買入 5億円 約定日 8/7

8/8の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,514,100	前日比	11,100
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後で推移すると見込まれる。

<< 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2兆7,000億円減少の11兆6,000億円(当座預金残高見込みは15兆3,000億円)。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%付近のビッドで始まり、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動きがあり、0.12%を超える水準でのビッドが見られた。その他の出合いは、0.06~0.063%中心に推移した。午後の出合いは調整程度にとどまり、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。

<< 7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。W I取引において0.020~0.0225%の出合いが見られていたものの、平均落札利回0.0236%、最高落札利回0.0280%と落ち着いた結果になった。セカンドラリーでは0.024~0.025%の出合いが見られた。CP市場は入札件数・発行額共に少なく、総額700億円弱程度の出合いと閑散であった。発行レートは概ね横ばい圏であった。

<< 8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
 *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月の景気ウォッチャー調査
 *米国6月の卸売売上高

JGB新発10年債	0.525	0.005	日経平均株価(終値)	15,232.37	72.58	為替(9時)	102.14-15
						為替(5時)	102.28-29

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	8/1	8/4	8/5	8/6	8/7
日銀当預残	1,520,600	1,527,700	1,482,800	1,524,800	1,530,700	1,503,000
準備預金残	1,389,500	1,399,900	1,356,700	1,399,600	1,399,800	1,375,800
レート	0.065%	0.068%	0.067%	0.072%	0.069%	0.070%
月中平均	0.06626%	0.06800%	0.06775%	0.06860%	0.06867%	0.06886%

「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