

◀ 資金需給 ▶

単位 億円

	8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
銀行券		▲ 600	900	0
財政		2,400	▲ 42,700	1,000
資金過不足		1,800	▲ 41,800	1,000
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		4,300		
		▲ 400	▲ 300	
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			▲ 100	
ETF買入		100	200	
国債補完供給				
小計		9,500	▲ 1,200	0
当預増減		11,300	▲ 43,000	1,000

当座預金残高	1,514,300	8/8以降の残り所要積立額	8,000
準備預金残高	1,393,300	8/11以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,183,500	積数	3,600
超過準備	1,183,300	1日平均	700
非準備先残高	121,000	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	99.81% (実績)		83.87% (日数)

8/7のマネタリーベース		2,412,000	
8/7コール	合計	164,960	無担 71,062 有担 93,898
コール前日増減	計	4,280	無担 4,660 有担 ▲ 380

8/8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		
0.060 ~0.135 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.058 ~0.135 (0.070)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.065 ~0.125 (0.086)				T/N	0.067 ~0.120 (0.080)			
0.125 (0.125)				S/N				
0.117 (0.117)				1W	0.117 ~0.255 (0.138)			
0.130 (0.130)				2W	0.118 ~0.340 (0.119)			
				3W	0.118 (0.118)			
0.255 (0.255)		0.08-0.12	-	1M	0.116 ~0.260 (0.120)			有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.022-0.023	3M				
		-	0.0110	6M				
		-	-	1Y				

◀ オペ情報、入札結果 ▶

ETF買入 156億円 約定日 8/8
J-REIT買入 5億円 約定日 8/8

◀ 日銀金融政策決定会合・結果 ▶
・マネタリーベースが、年間約60~70兆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。(全員一致)
・資産の買入れについては、以下の方針を継続する。
①長期国債について、保有残高が年間約50兆円に相当するペースで増加し、平均残存期間が7年程度となるよう買入れを行う。
②ETFおよびJ-REITについて、保有残高が、それぞれ年間約1兆円、年間約300億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。

「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

◀ 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	1,471,300	前日比	▲ 43,000
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%前後での推移が見込まれる。

◀ 8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1兆2,000億円減少の117兆8,000億円(当座預金残高見込みは151兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.065~0.069%、大手行から0.06~0.065%のビッドで始まり、週末要因から昨日より若干強めの立ち上がりとなった。一巡後の出合いは、0.065~0.066%中心に底堅く推移した。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、ロール案件中心の取引となった。

◀ 8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。短国市場は全般的に様子見の展開で、引け際に3M0.022~0.023%、6M0.011%の出合いが見られた程度であった。CP市場は、夏季休暇に入る企業が増えてきたこともあり、入札件数・発行額共に少なく、総額800億円弱程度の出合いと閑散であった。

◀ 11日の材料 ▶
*日銀金融経済月報
*6月の第3次産業活動指数
*7月のマネーストック *7月の消費動向調査

JGB新発10年債	0.500	▲ 0.025	日経平均株価(終値)	14,778.37	▲ 454.00	為替(9時)	102.13-14
						為替(5時)	101.69-70

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	8/1	8/4	8/5	8/6	8/7	8/8
日銀当預残	1,527,700	1,482,800	1,524,800	1,530,700	1,503,000	1,514,300
準備預金残	1,399,900	1,356,700	1,399,600	1,399,800	1,375,800	1,393,300
レート	0.068%	0.067%	0.072%	0.069%	0.070%	0.068%
月中平均	0.06800%	0.06775%	0.06860%	0.06867%	0.06886%	0.06860%