

**<<資金需給>>**

単位 億円

	24日需給速報		27日需給予想	28日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,000	300	1,000
財政		▲ 4,800	▲ 16,900	▲ 5,000
資金過不足		▲ 5,800	▲ 16,600	▲ 4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)			2,800	
65,743			▲ 2,600	
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				20,000
国庫短期証売却				
国債買入			12,200	
CP等買入				
		▲ 500	▲ 400	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援		1,100		
3,241		▲ 1,100		
社債等買入		▲ 100	▲ 100	
ETF買入				
国債補充供給				
小計		▲ 600	11,900	20,000
当預増減		▲ 6,400	▲ 4,700	16,000

当座預金残高	2,261,500	7/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,053,200		30,200
積み終了先	1,717,500	7/27以降の残り所要積立額	
超過準備	1,715,700	積数	17,400
非準備先残高	208,300	1日平均	900
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	2,021,900		
準備預金進捗率	99.14%	(実績)	35.48% (日数)

7/23のマナターベース		3,221,700	
7/23コール合計	208,819	無担	71,360
コール前日増減	計	2,332	無担
			74
			有担
			2,258

7/24の加重平均レート(速報)			7/23の加重平均レート(確報)		
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
0.055 ~0.080 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.055 ~0.125 (0.076)	
0.050 ~0.120 (0.078)				T/N	0.050 ~0.120 (0.077)
				S/N	
0.069 ~0.130 (0.105)				1W	0.080 ~0.117 (0.109)
				2W	
				3W	
		0.08-0.13	-	1M	0.141 (0.141)
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.004-▲0.002	3M	0.080 (0.080)
		-	-	6M	
		-	-	1Y	

**<<オペ情報、入札結果>>**

国短買入 20,000億円 7/28 応札 36,729億円 落札 20,002億円 按分利回り較差 0.005% 49.5% 平均利回り較差 0.009%  
 流動性供給 応札 1兆4,554億円 落札 4,987億円 7/28 募入最大利回り較差 ▲0.008% 按分 94.8196% 募入平均利回り較差 ▲0.010%  
 ETF買入 324億円 約定日 7/24

<< 7/27の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,256,800	前日比	▲ 4,700
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。

<< 24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1,000億円増加の171兆9,000億円(当座預金残高見込みは226兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀・地銀・信託業態から0.06~0.075%近辺の調達希望で始まった。週末であったが参加者の調達姿勢に大きな変化は無く、立ち上がりは0.075%近辺の出合いが中心。まとまった金額の取引に関しては0.07%台後半の出合いも散見されたが、一巡後は取り下がり、0.07%前後の出合いで推移した。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<< 24日のオープン市場動向 >>  
 現先レートS/Nは横ばい圏で推移した。短国市場では短国買入オペが2兆円で通知され、平均利回り較差+0.009%、按分利回り較差+0.005%、按分比率49.5%と落ち着いた結果となった。オペ前には3Mが▲0.004%まで買い進まれたが、オペ後には▲0.002%の出合いがみられた。CP市場は発行案件が少なく、償還総額1,900億円程度に対し、発行総額は300億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏との印象であった。

<< 27日の材料 >>  
 \*中曾日銀副総裁、熊本県金融経済懇談会にて講演  
 \*6月の企業向けサービス価格指数  
 \*米国6月の耐久財新規受注

JGB新発10年債	日経平均株価(終値)	為替(9時)	123.86-88
0.405 ▲ 0.005	20,544.53 ▲ 139.42	為替(5時)	123.91-93

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	7/16	7/17	7/21	7/22	7/23	7/24
日銀当預残	2,273,700	2,277,000	2,221,100	2,265,100	2,267,900	2,261,500
準備預金残	2,056,700	2,060,800	2,012,700	2,046,100	2,054,600	2,053,200
レート	0.075%	0.074%	0.076%	0.075%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07431%	0.07425%	0.07433%	0.07436%	0.07443%	0.07462%

「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