

<<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		600	▲ 400	0
財政		3,900	▲ 27,100	2,000
資金過不足		4,500	▲ 27,500	2,000
貸出				
売出手形		0		
本店共通		0		
全店共通		0		
共通(固定)		65,649		
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		4,700		12,000
CP等買入				
		▲ 200	▲ 400	
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		▲ 100		
ETF買入			200	
国債補充供給				
小計		4,400	▲ 200	12,000
当増減		8,900	▲ 27,700	14,000

当座預金残高	2,243,500	8/5以降の残り所要積立額	4,300
準備預金残高	2,039,900	8/6以降の残り所要積立額	3,700
積み終了先	1,712,300	積数	400
超過準備	1,712,300	1日平均	2,021,100
非準備先残高	203,600		
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	2,021,100		
準備預金進捗率	99.82% (実績)	67.74% (日数)	

8/4のマナタリーベース		3,189,400	
8/4コール	合計	205,925	無担 77,153 有担 128,772
コール前日増減	計	4,627	無担 5,197 有担 ▲ 570

8/5の加重平均レート(速報)			8/4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
0.060 ~0.125 (0.078)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.076)	
0.069 ~0.120 (0.079)				T/N	0.068 ~0.130 (0.082)
				S/N	
0.052 ~0.122 (0.076)				1W 0.064 ~0.070 (0.067)	0.098 ~0.140 (0.109)
0.170 (0.170)				2W	
				3W	
		0.08-0.13	-	1M	
		0.08-0.12	-	2M	有担先日付分
		0.08-0.12	-	3M	
		-	▲0.052-▲0.0158	6M	
		-	-	1Y	

<<オペ情報、入札結果>>

国債買入	3,750億円	8/7	応札	15,620億円	落札	3,753億円	按分利回り較差	0.001%	17.3%	平均利回り較差	0.005%
国債買入	4,250億円	8/7	応札	14,588億円	落札	4,258億円	按分利回り較差	0.006%	22.0%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	4,000億円	8/7	応札	11,857億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	0.013%	19.6%	平均利回り較差	0.016%
T-Bill6M	応札12兆3,669億円	落札3兆2,243億6,000万円(非競争入札:2,756億円)	8/10~2016/2/10	▲0.0158%	按分47.0610%	平均▲0.0218%					

「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。」

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	2,215,800	前日比	▲ 27,700
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。					

<< 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9,000億円増加の171兆3,000億円(当座預金残高見込みは224兆3,000億円)。朝方の無担O/Nは、都銀・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0.074~0.077%の出合いが中心となった。0.07%台後半ではまとまった金額の出合いが複数見られた。一巡後も同水準の出合いが続いた。なお、一部業態による試し取りが行われ、0.12%台での出合いも見られた。ターム物は閑散とした取引であった。

<< 5日のオープン市場動向 >>
 現先レートは横ばい圏で推移。短国市場は6M物の入札が実施された。W I取引で▲0.022~▲0.02%と強めの出合いが見られたこともあり、平均落札利回▲0.0218%、最高落札利回▲0.0158%と事前予想通りながらも強めの決着となった。セカンダリーは買入オペを睨んでか▲0.05%近辺まで買い進まれた。CP市場は、建設、鉄鋼業態等によるまとまった発行もあり総額1,200億円程度の出合いとなった。発行レートは引続き横ばいで推移した。

- << 6日の材料 >>**
- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(1日目、7日まで)
 - *6月の景気動向指数速報
 - *M P C (英中銀金融政策委員会、2日目)
 - *国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、8/10発行)
 - *流動性供給入札(3,000億円、8/10発行)
 - *交付税特別会計借入(10,500億円、8/14借入)

《コール7月の加重平均レート》			
(土日を含む)	無担	0.07429%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07395%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.395	0.010	日経平均株価(終値)	20,614.06	93.70	為替(9時)	124.28-30
						為替(5時)	124.40-42

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	8/3	8/4	8/5
日銀当預残	2,271,500	2,269,800	2,300,700	2,265,400	2,234,600	2,243,500
準備預金残	2,060,700	2,053,100	2,076,700	2,060,100	2,030,800	2,039,900
レート	0.074%	0.075%	0.064%	0.074%	0.076%	0.078%
月中平均	0.07462%	0.07463%	0.07429%	0.06733%	0.06950%	0.07120%

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録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