

**<<資金需給>>**

単位 億円

	11日需給速報		12日需給予想	13日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		500	▲ 600	0
財政		5,000	▲ 3,500	▲ 8,000
資金過不足		5,500	▲ 4,100	▲ 8,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
66,430				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			17,500	
国庫短期証売却				
国債買入			12,200	
CP等買入		3,500	▲ 500	
		▲ 100		
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				
ETF買入		800		
国債補完供給		▲ 300	300	
小計		3,900	29,500	0
当増減		9,400	25,400	▲ 8,000

<< 8/12の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,234,700	前日比	25,400
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。

<< 11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7,000億円増加の168兆8,000億円(当座預金残高見込みは221兆円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託・証券より0.07%台前半の調達希望で始まり、立ち上がりは0.075%を挟んだ出合いが中心となった。一巡後は0.07~0.075%程度の出合いが中心であった。ターム物は、大手行から2W物でまとまった調達が見られた。

<< 11日のオープン市場動向 >>  
 現先S/N物は横ばい圏での動きとなった。短国市場は、6M物が▲0.082%で小額出合った程度で閑散。CP市場は償還総額1,000億円程度に対し、案件数は少なかったものの、石油、鉄鋼、商社業態からまとまった発行が見られ、発行総額は1,400億円程度となった。発行レートは横ばい圏での動きとなった。

- << 12日の材料 >>  
 \*日銀金融政策決定会合議事要旨(7月14、15日開催分)  
 \*6月の第3次産業活動指数  
 \*6月の石油等消費動態統計  
 \*7月の企業物価指数  
 \*米国7月の財政収支

当座預金残高	2,209,300	8/11以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,006,300		800
積み終了先	1,683,300	8/12以降の残り所要積立額	
超過準備	1,683,300	積数	600
非準備先残高	203,000	1日平均	100
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	2,028,200		
準備預金進捗率	99.97% (実績)		87.10% (日数)

<b>JGB新発10年債</b>	<b>日経平均株価(終値)</b>	<b>為替(9時)</b>	<b>124.62-63</b>
0.395 ▲ 0.005	20,720.75 ▲ 87.94	為替(5時)	124.83-85

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	8/4	8/5	8/6	8/7	8/10	8/11
日銀当座預金	2,234,600	2,243,500	2,216,500	2,229,700	2,199,900	2,209,300
準備預金残	2,030,800	2,039,900	2,016,400	2,028,200	2,000,000	2,006,300
レート	0.076%	0.078%	0.076%	0.076%	0.075%	0.076%
月中平均	0.06950%	0.07120%	0.07200%	0.07333%	0.07350%	0.07373%

8/10のマナリーベース				3,154,200		
8/10コール合計	205,100	無担	74,030	有担	131,070	
コール前日増減	計	3,563	無担	2,340	有担	1,223

8/11の加重平均レート(速報)				8/10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
0.055 ~ 0.125 (0.076)	0.030	~ 0.040 (0.031)				O/N	0.050 ~ 0.125 (0.075)		0.030 ~ 0.040 (0.031)
0.073 ~ 0.120 (0.081)						T/N		0.073 ~ 0.130 (0.083)	
						S/N			
0.130 (0.130)						1W	0.125 (0.125)	0.110 ~ 0.117 (0.114)	
0.114 ~ 0.170 (0.118)						2W	0.118 (0.118)	0.310 (0.310)	
						3W	0.118 (0.118)		
0.075 ~ 0.130 (0.097)				0.08-0.13	-	1M			有担先日付分
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	-	3M			
				-	▲0.082	6M			
				-	-	1Y			

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債補完 1,586億円 8/11 ~ 8/12 (1日間) 応札 235億円 落札 235億円 -0.400% 全取 平均 -0.400% (即)  
 米ドル資金供給(固定金利方式) 8/13~8/20 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.640%  
 30年利付国債(表面利率1.6%) 応札2兆4,096億円 落札7,296億円(I非競争入札:694億円) 8/13~2045/6/20 1.451% 按分29.9709% 平均1.444%  
 J-REIT買入 13億円 約定日 8/11

「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