

◀資金需給▶

単位 億円

	12日需給速報		13日需給予想	14日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		200	▲ 400	▲ 1,000
財政		2,400	▲ 7,300	▲ 7,000
資金過不足		2,600	▲ 7,700	▲ 8,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
104,128				
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			25,000	
国庫短期証売却				
国債買入			9,100	
CP等買入				
		▲ 400	▲ 200	
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				
ETF買入		100	100	
国債補完供給		100		
小計		▲ 200	34,000	0
当預増減		2,400	26,300	▲ 8,000

当座預金残高	1,473,800	8/12以降の残り所要積立額	2,600
準備預金残高	1,349,400	8/13以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,141,800	積数	1,700
超過準備	1,141,800	1日平均	600
非準備先残高	124,400		
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	99.91% (実績)	90.32% (日数)	

8/11のマネタリーベース				2,380,000	
8/11コール	合計	173,118	無担	74,140	有担
98,978					
コール前日増減	計	3,805	無担	▲ 315	有担
4,120					

◀ 8/13の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,500,100	前日比	26,300
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%程度で推移することが見込まれる。

◀ 12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4,000億円増加の114兆2,000億円(当座預金残高見込みは147兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.061~0.065%、大手行から0.06%付近のビッドで始まるなど、昨日同様に落ち着いた立ち上がりとなった。一巡後の出合いは、0.061~0.064%中心に推移した。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。

◀ 12日のオープン市場動向 ▶
 現先レートS/Nは小幅低下となった。短国アウトライト市場は品薄感が強く、全般的に様子見の展開が続いていた。CP発行市場は夏季休暇の影響から件数も少なく、総額120億円程度の出合いと閑散であった。

- ◀ 13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)
 - *4-6月期のGDP1次速報(市場予想：前期比年率▲7.1%)
 - *6月のマネタリーサーベイ
 - *米国6月の企業在庫 *米国7月の小売売上高
 - *国庫短期証券入札(2ヶ月、25,000億円、8/15発行)

JGB新発10年債	0.510	0.000	日経平均株価(終値)	15,161.31	30.79	為替(9時)	102.22-23
						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	8/5	8/6	8/7	8/8	8/11	8/12
日銀当預残	1,524,800	1,530,700	1,503,000	1,514,300	1,471,400	1,473,800
準備預金残	1,399,600	1,399,800	1,375,800	1,393,300	1,350,000	1,349,400
レート	0.072%	0.069%	0.070%	0.068%	0.066%	0.067%
月中平均	0.06860%	0.06867%	0.06886%	0.06860%	0.06836%	0.06825%

8/12の加重平均レート(速報)				8/11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	有担先日付分	
0.045 ~0.125 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.045 ~0.135 (0.066)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.064 ~0.125 (0.073)				T/N	0.063 ~0.120 (0.074)			
0.125 (0.125)				S/N				
0.071 (0.071)				1W	0.117 ~0.400 (0.140)			
0.118 ~0.330 (0.153)				2W	0.118 ~0.145 (0.120)			
				3W	0.118 (0.118)			
		0.08-0.12	-	1M	0.118 (0.118)		有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	-	3M	0.250 ~0.400 (0.310)			
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

◀オペ情報、入札結果▶

米ドル資金供給(固定金利方式) 8/14~8/21 (7日間) 応札なし 貸付利率 0.590%
 30年利付国債(表面利率1.7%) 応札2兆2,211億円 落札5,467億円(I非競争入札:525億円) 8/14~2044/6/20 1.679% 按分54.0423% 平均1.676%
 交付税特会 1兆500億円 8/20~2015/2/18 応札3兆476億円 落札1兆500億円 0.098% 按分97.4531% 平均0.097%

「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す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