

《資金需給》

単位 億円

	13日需給速報		14日需給予想	15日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	▲ 1,200	▲ 1,000
財政		▲ 7,400	▲ 4,400	42,000
資金過不足		▲ 7,700	▲ 5,600	41,000
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		2,400
CP等買入		▲ 200	▲ 400	
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				1,000
ETF買入		100	100	
国債補完供給				
小計		34,000	▲ 300	3,400
当預増減		26,300	▲ 5,900	44,400

《 8/14の日銀調節とレート予想 》					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,494,200	前日比	▲ 5,900
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。

《 13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2兆5,000億円増加の116兆7,000億円(当座預金残高見込みは150兆円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.062~0.065%、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、0.06~0.064%中心に推移した。午後に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、大手行が1W物0.117%、2W・1M物0.118%での調達を行った。

《 13日のオープン市場動向 》

現先レートS/Nは低下基調での推移となった。短国市場は2M物の入札が実施された。W I取引においては0.020%の出合いも見られていたものの、結果は平均落札利回0.0250%、最高落札利回0.0266%と落ちていた。セカンダリーでは、落札水準での出合いが見られた程度であった。CP市場は夏季休暇期間ながらも、15日発行となったことで総額1,700億円程度の出合いが見られた。発行レートは動意に乏しく、レートは引き続き横ばいの展開が続いていた。

《 14日の材料 》

- \*6月の機械受注統計(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+15.3%)
- \*ユーロ圏4-6月期のGDP速報値
- \*ユーロ圏7月の消費者物価指数改定値
- \*国庫短期証券入札(3ヶ月、57,000億円、8/18発行)
- \*5年利付国債入札(27,000億円、8/18発行)

当座預金残高	1,500,100	8/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,370,400		1,700
積み終了先	1,164,500	8/14以降の残り所要積立額	
超過準備	1,164,500	積数	900
非準預先残高	129,700	1日平均	500
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	99.95% (実績)		93.55% (日数)

JGB新発10年債	0.510	0.000	日経平均株価(終値)	15,213.63	52.32	為替(9時)	102.28-29
						為替(5時)	102.45-47

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	8/6	8/7	8/8	8/11	8/12	8/13
日銀当預残	1,530,700	1,503,000	1,514,300	1,471,400	1,473,800	1,500,100
準備預金残	1,399,800	1,375,800	1,393,300	1,350,000	1,349,400	1,370,400
レート	0.069%	0.070%	0.068%	0.066%	0.067%	0.067%
月中平均	0.06867%	0.06886%	0.06860%	0.06836%	0.06825%	0.06815%

8/12のマネタリーベース				2,382,200		
8/12コール	合計	171,429	無担	74,850	有担	96,579
コール前日増減	計	▲ 1,689	無担	710	有担	▲ 2,399

8/13の加重平均レート(速報)				8/12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		有担当日分
0.045 ~0.135 (0.067)	0.030 ~0.040 (0.031)					0.045 ~0.125 (0.067)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.061 ~0.130 (0.070)							0.064 ~0.125 (0.073)	
							0.068 ~0.125 (0.071)	
0.080 ~0.089 (0.086)							0.071 (0.071)	
0.330 (0.330)							0.118 ~0.330 (0.153)	
0.255 (0.255)				0.08-0.12	-		0.260 (0.260)	有担先日付分
				0.08-0.12	0.0200-0.0266			
				0.08-0.12	0.0100-0.0130			
				-	-			
				-	-			
				-	-			

《オペ情報、入札結果》

国債買入	1,100億円	8/15	応札	4,852億円	落札	1,100億円	按分利回り較差	0.012%	58.0%	平均利回り較差	0.015%
国債買入	1,000億円	8/15	応札	4,579億円	落札	1,007億円	按分利回り較差	0.006%	7.1%	平均利回り較差	0.007%
国債買入	300億円	8/15	応札	1,221億円	落札	303億円	按分利回り較差	0.003%	89.0%	平均利回り較差	0.003%
T-Bill2M	応札14兆3,190億円	落札2兆3,141億5,000万円(非競争入札:1,858億円)	8/15~10/2	0.0266%	按分	86.1119%	平均	0.0250%			

「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り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