

**<<資金需給>>**

単位 億円

	14日需給速報		15日需給予想	18日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,200	▲ 1,100	1,000
財政		▲ 4,000	39,800	▲ 44,000
資金過不足		▲ 5,200	38,700	▲ 43,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				4,800
104,128				▲ 3,900
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			2,500	
CP等買入		▲ 400	▲ 700	
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		
国債補充供給				
小計		▲ 300	2,800	900
当預増減		▲ 5,500	41,500	▲ 42,100

当座預金残高	1,494,600	8/14以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,369,400		900
積み終了先	1,161,800	8/15以降の残り所要積立額	
超過準備	1,161,000	積数	0
非準備先残高	125,200	1日平均	0
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	100.00%	(実績)	96.77% (日数)

8/13のマナタリーベース		2,408,800		
8/13コール	合計	173,524	無担	78,235
コール前日増減	計	2,095	無担	3,385
			有担	▲ 1,290

8/14の加重平均レート(速報)				8/13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	単位(%)	
0.040 ~0.135 (0.068)	0.030	~0.040 (0.031)				O/N	0.045 ~0.135 (0.067)
0.064 ~0.123 (0.072)						T/N	0.061 ~0.130 (0.070)
						S/N	
0.113 ~0.120 (0.118)						1W	0.080 ~0.089 (0.086)
0.118 (0.118)						2W	0.330 (0.330)
						3W	
0.118 ~0.350 (0.145)				0.08-0.12	-	1M	0.255 (0.255)
				0.08-0.12	0.0250	2M	
				0.08-0.12	0.022-0.026	3M	
				-	-	6M	
				-	-	1Y	

**<<オペ情報、入札結果>>**

全店共通 8,000億円 8/18 ~ 11/17 (91日間) 応札 4,831億円 落札 4,831億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)  
 T-Bill3M 応札28兆6,063億円 落札5兆1,720億3,000万円(非競争入札:4,779億円) 8/18~11/17 0.0260% 按分39.3546% 平均0.0228%  
 5年利付国債(表面利率0.2%) 応札11兆9,617億円 落札2兆4,540億円(I非競争入札:2,435億円) 8/18~2019/6/20 0.147% 按分24.6586% 平均0.147%

8/15の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,536,100	前日比	41,500
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%前後での推移が見込まれる。

**<< 14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5,000億円減少の116兆2,000億円(当座預金残高見込みは149兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.06~0.065%、大手行から0.06%付近のビッドで始まり、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。午後のお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。

**<< 14日のオープン市場動向 >>**  
 現先レートS/Nは発行日要因から上昇した。短国市場は3Mの入札が実施された。W I取引において0.022%の出合いが見られる中、結果は平均落札利回0.0228%、最高落札利回0.026%と概ね事前予想通りであった。セカンダリーでは0.0228%で出合った後、足元金利の上昇を受けた調整売りが出たことで、0.025%でまとまった出合いが見られた。CP市場は夏季休暇のため市場参加者が少なく、総額500億円程度の出合いにとどまるなど、閑散とした取引であった。

**<< 15日の材料 >>**  
 \*英国4-6月期のGDP改定値  
 \*米国7月の生産者物価指数  
 \*米国7月の鉱工業生産・設備稼働率  
 \*米国8月のミシガン大消費者信頼感指数速報

JGB新発10年債	0.500	▲ 0.010	日経平均株価(終値)	15,314.57	100.94	為替(9時)	102.41-42
						為替(5時)	102.46-48

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	8/7	8/8	8/11	8/12	8/13	8/14
日銀当預残	1,503,000	1,514,300	1,471,400	1,473,800	1,500,100	1,494,600
準備預金残	1,375,800	1,393,300	1,350,000	1,349,400	1,370,400	1,369,400
レート	0.070%	0.068%	0.066%	0.067%	0.067%	0.068%
月中平均	0.06886%	0.06860%	0.06836%	0.06825%	0.06815%	0.06814%

「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