

◀資金需給▶

単位 億円

	15日需給速報		18日需給予想	19日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	1,200	1,000
財政		39,600	▲ 39,700	1,000
資金過不足		38,700	▲ 38,500	2,000
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				20,000
国庫短期証売却				
国債買入		2,500		9,000
CP等買入				
		▲ 700	▲ 100	
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	
国債補完供給				
小計		2,800	900	29,000
当預増減		41,500	▲ 37,600	31,000

当座預金残高	1,536,100	8/15以降の残り所要積立額	0
準備預金残高	1,399,800	8/18以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,177,300	積数	402,800
超過準備	1,177,300	1日平均	13,900
非準備先残高	136,300	積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	1,911,300
8月の新所要見込		61,300	(一日平均)

8/14のマネタリーベース		2,404,400	
8/14コール	合計	175,654	無担 80,641 有担 95,013
コール前日増減	計	2,130	無担 2,406 有担 ▲ 276

8/15の加重平均レート(速報)			8/14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
0.040 ~0.135 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.040 ~0.135 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.061 ~0.125 (0.080)				T/N	0.064 ~0.123 (0.072)	
				S/N		
0.116 ~0.200 (0.149)				1W	0.113 ~0.120 (0.118)	
0.118 (0.118)				2W	0.118 (0.118)	
				3W		
0.116 ~0.118 (0.117)		0.08-0.12	-	1M	0.118 ~0.350 (0.145)	有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	0.0240	3M		
		-	-	6M		
		-	-	1Y		

◀オペ情報、入札結果▶

国短買入	20,000億円	8/19	応札	36,082億円	落札	20,003億円	按分利回り較差	-0.001%	76.1%	平均利回り較差	0.001%
国債買入	3,000億円	8/19	応札	14,271億円	落札	3,005億円	按分利回り較差	0.003%	14.8%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	2,000億円	8/19	応札	9,885億円	落札	2,002億円	全取利回り較差	0.006%		平均利回り較差	0.006%
国債買入	4,000億円	8/19	応札	11,321億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	-0.003%	41.9%	平均利回り較差	-0.002%

◀ 8/18の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,498,500	前日比	▲ 37,600
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%程度での推移が見込まれる。

◀ 15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2兆3,000億円増加の118兆5,000億円(当座預金残高見込みは153兆6,000億円)。朝方の無担O/Nは地銀、信託業態から0.065~0.068%、大手行から0.065%のビッドで始まった。週末要因を受け、昨日と比べて強めの立ち上がりとなった。一巡後の出合いは、0.065%中心に底堅く推移した。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。

◀ 15日のオープン市場動向 ▶
 現先レートS/Nは横ばい圏の出合いであった。短国アウトライト市場は、買入オペが2兆円で実施された。前日比5,000億円の減額となったものの、平均利回較差+0.001%、按分利回較差▲0.001%と市場実勢水準の落ち着いた結果となった。CP市場は800億円程度の発行にとどまるなど、引き続き閑散であった。

◀ 18日の材料 ▶
 *国庫短期証券入札(1年、25,000億円、8/20発行)

◀コール7月積み期間分の加重平均レート▶			
(土日を含む)	無担	0.06761%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06727%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.500	0.000	日経平均株価(終値)	15,318.34	3.77	為替(9時)	102.51-52
						為替(5時)	102.52-53

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	8/8	8/11	8/12	8/13	8/14	8/15
日銀当預残	1,514,300	1,471,400	1,473,800	1,500,100	1,494,600	1,536,100
準備預金残	1,393,300	1,350,000	1,349,400	1,370,400	1,369,400	1,399,800
レート	0.068%	0.066%	0.067%	0.067%	0.068%	0.068%
月中平均	0.06860%	0.06836%	0.06825%	0.06815%	0.06814%	0.06812%

「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