

◀資金需給▶

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想		21日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		700	0	▲1,000		
財政		0	▲16,300	▲13,000		
資金過不足		700	▲16,300	▲14,000		
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						
105,069						
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		9,200				
CP等買入					4,400	
		▲300	▲600			
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						
国債補完供給						
小計		28,900	▲600	4,400		
当預増減		29,600	▲16,900	▲9,600		
当座預金残高	1,528,200	8/19以降の残り所要積立額				
準備預金残高	1,392,100	285,300				
積み終了先	1,116,800	8/20以降の残り所要積立額				
超過準備	1,115,600	積数				
非準備先残高	136,100	1日平均				
		8,600				
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)		1,901,100				
準備預金進捗率	87.82%	(実績)	12.90%	(日数)		

◀ 8/20の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,511,300	前日比	▲16,900
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%程度での出合いが中心になると見込まれる。

◀ 19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3兆1,000億円増加の117兆円(当座預金残高見込みは152兆7,000億円)。無担O/Nは大手行から0.06%、地銀、信託、証券業態からは0.06~0.065%前後の調達希望で始まった。一部業態より0.125%で少額の試し取りが行われたものの、一巡後は0.061%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。T/Nは0.065%の出合いがみられ、ターム物に関してはロール案件による出合いが散見された。米ドル資金供給オペが1W物でオファーされ、落札は200万ドルの結果となった。

◀ 19日のオープン市場動向 ▶
 現先S/N物は横ばい圏での推移となった。短国市場は動意に乏しく閑散であり、3M0.023~0.025%、1Y0.015~0.016%で出合いが見られた程度であった。CP市場は、鉄鋼・電機業態からまとまった発行案件が見られ、発行総額は1,200億円程度まで膨らんだ。発行レートは足元金利の高止まりから上昇傾向で推移となっていた。

◀ 20日の材料 ▶
 *7月の貿易統計

◀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		日経平均株価(終値)		為替(9時)	
0.500	0.005	15,449.79	127.19	102.62-64	102.59-61

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	8/12	8/13	8/14	8/15	8/18	8/19
日銀当預残	1,473,800	1,500,100	1,494,600	1,536,100	1,498,600	1,528,200
準備預金残	1,349,400	1,370,400	1,369,400	1,399,800	1,363,600	1,392,100
レート	0.067%	0.067%	0.068%	0.068%	0.066%	0.067%
月中平均	0.06825%	0.06815%	0.06814%	0.06812%	0.06800%	0.06795%

8/18のマネタリーベース			
8/18コール	合計	166,538	無担 71,240 有担 95,298
コール前日増減	計	▲4,759	無担 ▲4,698 有担 ▲61

8/19の加重平均レート(速報)				8/18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	O/N	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.040	~0.135 (0.067)	0.030	~0.040 (0.031)			0.045	~0.135 (0.066)		0.030
0.065	~0.120 (0.078)					T/N		0.061	~0.125 (0.085)
						S/N			
0.071	~0.117 (0.107)					1W		0.117	~0.400 (0.151)
0.118	(0.118)					2W		0.118	(0.118)
0.115	(0.115)					3W			
0.118	(0.118)			0.08-0.12	-	1M		0.118	(0.118)
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	0.023-0.025	3M			
				-	-	6M			
				-	0.015-0.016	1Y			

◀オペ情報、入札結果▶

米ドル資金供給(固定金利方式) 8/21~8/28 (7日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.590%
 20年利付国債(表面利率1.5%) 応札3兆9,539億円 落札1兆913億円(I非競争入札:1,075億円) 8/21~2034/6/20 1.343% 按分70.9289% 平均1.342%
 交付税特会 1兆500億円 8/27~2015/2/27 応札 2兆4,546億円 落札 1兆500億円 0.100% 按分 5.5683% 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