

<<資金需給>>

単位 億円

	21日需給速報		22日需給予想	25日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300	▲ 2,000	1,000
財政		▲ 13,500	▲ 1,400	▲ 16,000
資金過不足		▲ 14,800	▲ 3,400	▲ 15,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				4,000
105,069				▲ 3,400
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			6,400	
CP等買入		4,400		
		▲ 500	▲ 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				
ETF買入				
国債補充供給				
小計		3,900	5,700	600
当預増減		▲ 10,900	2,300	▲ 14,400

当座預金残高	1,500,300	8/21以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,363,500		183,300
積み終了先	1,107,200	8/22以降の残り所要積立額	
超過準備	1,103,600	積数	145,500
非準備先残高	136,800	1日平均	5,800
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	92.35% (実績)		19.35% (日数)

8/20のマナタリーベース		2,419,900	
8/20コール	合計	169,656	無担 73,471 有担 96,185
コール前日増減	計	769	無担 376 有担 393

8/21の加重平均レート(速報)				8/20の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		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)		0.055 ~0.135 (0.073)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.066 ~0.120 (0.078)						0.065 ~0.120 (0.086)		
0.125 (0.125)								
						0.088 ~0.145 (0.103)		
0.118 ~0.340 (0.155)								
						0.075 (0.075)		
0.118 ~0.210 (0.164)			0.08~0.12	0.035~0.045	1M	0.118 ~0.280 (0.133)		有担先日付分
			0.08~0.12	0.0275~0.030	2M			
			0.08~0.12	0.026~0.032	3M			
			-	-	6M			
			-	0.013~0.017	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通 8,000億円 8/25 ~ 11/25 (92日間) 応札 4,032億円 落札 4,032億円 0.100% 全取 平均 0.100% (固定)
 T-Bill3M 応札27兆6,617億円 落札5兆2,629億円(非競争入札:4,770億3,000万円) 8/25~11/25 0.0317% 按分77.0528% 平均0.0289%
 流動性供給 応札 1兆6,174億円 落札 3,996億円 8/25 募入最大利回較差 0.015% 按分 34.2989% 募入平均利回較差 0.013%

「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

<< 8/22の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,502,600	前日比	2,300
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.065%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 21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114兆5,000億円(当座預金残高見込みは150兆円)。無担O/Nは0.065%の出合いで立ち上がり、大手行から0.06%、地銀・信託・証券業態から0.064~0.066%前後の調達希望で始まった。一巡後は0.061~0.062%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0.066%の出合いがみられた。3M物の共通担保オペが8,000億円オフアールされ、結果は落札総額4,032億円で札割れとなった。

<< 21日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、短国の発行日にあたるため、やや高めに推移した。短国市場は、新発3M物の入札が実施され、最高落札利回り0.0317%、平均落札利回り0.0289%、按分77.0528%と概ね事前予想通りの結果となった。アウトライトは、1M:0.035~0.045%、2M:0.0275~0.03%、3M:0.026~0.032%、1Y:0.013~0.017%の出合い。CP市場は、「5・10日」にあたることから鉄鋼を中心に様々な業態から大型の発行が実施され、発行総額は3,200億円程度となった。発行レートは引き続き横ばいであった。

<< 22日の材料 >>
 *イエレンFRB議長 カンザスシティ地区連銀経済シンポジウムにて講演

<<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	0.530	0.020	日経平均株価(終値)	15,586.20	131.75	為替(9時)	103.70-71
						為替(5時)	103.82-83

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	8/14	8/15	8/18	8/19	8/20	8/21
日銀当預残	1,494,600	1,536,100	1,498,600	1,528,200	1,511,200	1,500,300
準備預金残	1,369,400	1,399,800	1,363,600	1,392,100	1,372,000	1,363,500
レート	0.068%	0.068%	0.066%	0.067%	0.073%	0.067%
月中平均	0.06814%	0.06812%	0.06800%	0.06795%	0.06820%	0.06814%