

<<資金需給>>

単位 億円

	22日需給速報		25日需給予想	26日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 2,000	400	0
財政		▲ 2,200	▲ 21,300	1,000
資金過不足		▲ 4,200	▲ 20,900	1,000
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				30,000
国庫短期証売却				
国債買入		6,400		9,000
CP等買入		▲ 700	▲ 900	
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			▲ 100	
ETF買入				
国債補完供給				
小計		5,700	▲ 400	39,000
当預増減		1,500	▲ 21,300	40,000

当座預金残高	1,501,800	8/22以降の残り所要積立額	145,500
準備預金残高	1,363,600	8/25以降の残り所要積立額	78,800
積み終了先	1,126,700	積数	1日平均
超過準備	1,119,000		3,600
非準備先残高	138,200		
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	95.86% (実績)	29.03% (日数)	

8/21のマナタリーベース		2,410,300	
8/21コール合計	166,083 無担	70,243 有担	95,840
コール前日増減	計 ▲ 3,573 無担	▲ 3,228 有担	▲ 345

8/22の加重平均レート(速報)			
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国
0.040 ~0.135 (0.068)	0.030 ~0.040 (0.031)		
0.062 ~0.125 (0.074)			
0.096 ~0.130 (0.102)			
0.270 (0.270)			
		0.08-0.12	-
		0.08-0.12	-
		0.08-0.12	0.030-0.032
		-	-
		-	0.016-0.0175

<< 8/25の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,480,500	前日比	▲ 21,300
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.06~0.07%程度での出合いが見込まれる。

<< 22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1,000億円減少の114兆4,000億円(当座預金残高見込みは150兆3,000億円)。無担O/Nは、週末要因によって昨日より若干強めの調達希望となり、0.067%中心の出合いとなった。大手行から0.065%、地銀・信託・証券業態を中心に0.066~0.068%前後の調達がみられた。一巡後も0.065~0.068%を中心とした底堅い出合いで推移し、本日の取引を終了した。ターム物に関しては、ロール案件中心の取引となった。

<< 22日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは、やや落ち着いた推移となった。短国市場は、買入オペが3兆円でオファーされ、按分落札利回り較差+0.002%、平均落札利回り較差+0.002%、按分率93.4%と、需給の悪化を反映して小甘い結果となった。アウトライトでは、3M:0.03~0.032%、1Y:0.016~0.0175%での出合いが見られた。CP市場は、不動産・ノンバンク業態から大型の発行が実施されたものの、発行総額は1,300億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい。

<< 25日の材料 >>
 *米国8月の新築一戸建て販売件数
 *サマー・バンクホリデー(英国市場休場)

JGB新発10年債	0.510	▲ 0.020	日経平均株価(終値)	15,539.19	▲ 47.01	為替(9時)	103.85-86
						為替(5時)	103.76-77

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	8/15	8/18	8/19	8/20	8/21	8/22
日銀当預残	1,536,100	1,498,600	1,528,200	1,511,200	1,500,300	1,501,800
準備預金残	1,399,800	1,363,600	1,392,100	1,372,000	1,363,500	1,363,600
レート	0.068%	0.066%	0.067%	0.073%	0.067%	0.068%
月中平均	0.06812%	0.06800%	0.06795%	0.06820%	0.06814%	0.06813%

8/22の加重平均レート(速報)				8/21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 (0.067)		0.030 ~0.040 (0.031)		
0.062 ~0.125 (0.074)				T/N	0.066 ~0.120 (0.078)			
0.096 ~0.130 (0.102)				S/N	0.125 (0.125)			
0.270 (0.270)				1W				
				2W	0.118 ~0.340 (0.155)			
				3W				
		0.08-0.12	-	1M	0.118 ~0.210 (0.164)	有担先日付分		
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.030-0.032	3M				
		-	-	6M				
		-	0.016-0.0175	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	30,000億円	8/26	応札	48,543億円	落札	30,003億円	按分利回り較差	0.002%	93.4%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	3,000億円	8/26	応札	10,710億円	落札	3,000億円	按分利回り較差	0.008%	97.9%	平均利回り較差	0.008%
国債買入	2,000億円	8/26	応札	9,630億円	落札	2,006億円	按分利回り較差	0.003%	13.5%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,000億円	8/26	応札	11,390億円	落札	4,008億円	按分利回り較差	0.003%	78.9%	平均利回り較差	0.004%

「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