

<<資金需給>>

単位 億円

	25日需給速報		26日需給予想	27日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	200	0
財政		▲ 21,400	8,200	1,000
資金過不足		▲ 21,300	8,400	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		
105,671		▲ 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			9,200	
CP等買入				
		▲ 900	▲ 400	
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	▲ 200	
ETF買入				
国債補充供給				
小計		▲ 400	38,600	0
当預増減		▲ 21,700	47,000	1,000

当座預金残高	1,480,100	8/25以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,350,600		78,800
積み終了先	1,115,600	8/26以降の残り所要積立額	
超過準備	1,113,000	積数	63,600
非準備先残高	129,500	1日平均	3,000
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	96.65% (実績)	32.26% (日数)	

8/22のマナターベース				2,413,800
8/22コール	合計	165,608	無担	68,943
			有担	96,665
コール前日増減	計	▲ 475	無担	▲ 1,300
			有担	825

8/25の加重平均レート(速報)				8/22の加重平均レート(確報)			
無担(平均)		有担(平均)		無担当日分		有担当日分	
0.055 ~0.135 (0.068)	0.030	~0.040 (0.031)		0.040 ~0.135 (0.068)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.065 ~0.120 (0.071)					0.062 ~0.125 (0.074)		
0.200 ~0.400 (0.258)					0.096 ~0.130 (0.102)		
0.118 (0.118)					0.270 (0.270)		
0.118 (0.118)			0.08-0.12	-			有担先日付分
			0.08-0.12	-			
0.120 (0.120)			0.08-0.12	-			
			-	-			
			-	-			

<<オペ情報、入札結果>>

CP買入 4,500億円 8/28 応札 8,433億円 落札 4,123億円 按分レート 0.093% 58.8% 平均落札レート 0.095%
被災地支援(第40回) 8/29~2015/8/28 (364日間) 貸付予定総額 506億円(大手行 2億円、地域金融機関等 504億円) 貸付利率 0.10%

「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

8/26の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	1,527,100	前日比	47,000
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%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 25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2兆3,000億円減少の112兆1,000億円(当座預金残高見込みは148兆1,000億円)。無担O/Nは地銀・信託・証券業態から0.065%前後の出合いで始まった。大手行からは0.06%の調達希望が見られた。一巡後は調達側が薄くなる中、0.061~0.062%の水準で出合いが散見されつつ、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。

<< 25日のオープン市場動向 >>
現先取引S/Nはほぼ横ばい水準で推移した。短国市場は動意に乏しく、終日閑散であった。CP市場は電力業態からまとまった発行が見られたが、全体の案件数は少なめで、発行総額は700億円程度にとどまった。先週末までのレート上昇基調を引き継ぎ、発行水準は若干の上昇が見られた。CP等買入オペが実施され、特定銘柄の強い売却ニーズを反映し、各利回りは按分0.093%・平均0.095%と、前回(0.092%・0.094%)から上昇した。

- << 26日の材料 >>**
- *7月の企業向けサービス価格指数
 - *月例経済報告
 - *米国6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
 - *米国7月の耐久財新規受注
 - *米国8月のCB消費者信頼感指数
 - *40年利付国債入札(4,000億円、8/28発行)
 - *交付税特別会計借入(10,500億円、9/3借入)

JGB新発10年債	0.505	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	15,613.25	74.06	為替(9時)	104.19-21
						為替(5時)	104.12-14

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	8/18	8/19	8/20	8/21	8/22	8/25
日銀当預残	1,498,600	1,528,200	1,511,200	1,500,300	1,501,800	1,480,100
準備預金残	1,363,600	1,392,100	1,372,000	1,363,500	1,363,600	1,350,600
レート	0.066%	0.067%	0.073%	0.067%	0.068%	0.068%
月中平均	0.06800%	0.06795%	0.06820%	0.06814%	0.06813%	0.06812%