

<<資金需給>>

単位 億円

	13日需給速報		14日需給予想		17日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		▲ 1,300		▲ 900		1,000
財政		▲ 11,400		71,400		▲ 26,000
資金過不足		▲ 12,700		70,500		▲ 25,000
貸出						
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)						1,200
66,430						▲ 1,300
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				4,700		
CP等買入						
		▲ 800		▲ 300		
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836						
被災地支援						
3,241						
社債等買入						
ETF買入		100		200		
国債補完供給 即日		▲ 100		100		
小計		▲ 800		4,700		▲ 100
当預増減		▲ 13,500		75,200		▲ 25,100

当座預金残高	2,221,100	8/13以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,025,200		300
積み終了先	1,699,900	8/14以降の残り所要積立額	
超過準備	1,699,800	積数	100
非準備先残高	195,900	1日平均	0
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額(積数)	2,028,200		
準備預金進捗率	100.00% (実績)	93.55%	(日数)

8/12のマネタリーベース		3,189,100	
8/12コール 合計	208,069	無担	77,403
		有担	130,666
コール前日増減 計	4,044	無担	3,943
		有担	101

8/13の加重平均レート(速報)				8/12の加重平均レート(確報)			
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	有担先日付分
0.055 ~0.125 (0.075)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.055 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.075 ~0.120 (0.083)					0.073 ~0.120 (0.085)		
0.117 ~0.130 (0.121)					0.052 ~0.130 (0.086)		
0.110 ~0.118 (0.116)					0.116 (0.116)		
0.140 ~0.143 (0.142)		0.08-0.13	-		0.232 (0.232)	有担先日付分	
		0.08-0.12	-				
		0.08-0.12	▲0.008-▲0.002				
		-	▲0.085-▲0.082				
		-	-				

<<オペ情報、入札結果>>

全店共通	8,000億円	8/17 ~ 11/16 (91日間)	応札	1,240億円	落札	1,240億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	8,231億円	8/13 ~ 8/14 (1日間)	応札	79億円	落札	79億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
T-Bill3M	応札21兆2,806億円	落札4兆6,440億2,000万円(非競争入札:4,259億円)	8/17~11/16	▲0.0040%	按分	49.0143%	平均	▲0.0056%		
5年利付国債(表面利率0.1%)	応札7兆9,064億円	落札2兆2,937億円(I 非競争入札:2,039億円)	8/17~2020/6/20	0.091%	按分	5.9890%	平均	0.089%		
ETF買入	337億円	約定日	8/13							
J-REIT買入	13億円	約定日	8/13							

「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。」

8/14の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,296,300	前日比	75,200
O/N	0.065~0.075	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.065~0.075%前後での出合いが中心になると見込まれる。					

<< 13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1兆円減少の169兆9,000億円(当座預金残高見込みは222兆4,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀・信託・証券より0.07%前半で始まり、出合いの中心は0.075%と昨日とほぼ同水準の立ち上がりとなった。一巡後は0.07%近辺の出合いが中心であったが、まとまった金額の取引に関しては0.075%を上回る出合いも散見された。ターム物は、ロール案件の取引が中心となった。

<< 13日のオープン市場動向 >>
 現先S/N物は横ばい圏での動きとなった。短国市場では3M物(551回)入札が実施され、平均落札利回▲0.0056% 按分落札利回▲0.004% 按分率49.0143%と概ね市場予想通りの結果となった。セカンダリーは▲0.002%まで出合うなど小甘い展開であった。CP市場は、償還総額1,600億円程度に対し、発行総額は1,000億円程度にとどまった。発行レートは概ね横ばい圏での動きとなった。

<< 14日の材料 >>
 *米国7月の生産者物価指数
 *米国7月の鉱工業生産・設備稼働率
 *米国8月のミンガン大消費者信頼感指数速報
 *ユーロ圏4-6月期のGDP速報値
 *ユーロ圏7月の消費者物価指数改定値

JGB新発10年債	0.375	0.020	日経平均株価(終値)	20,595.55	202.78	為替(9時)	124.29-31
						為替(5時)	124.58-60

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	8/6	8/7	8/10	8/11	8/12	8/13
日銀当預残	2,216,500	2,229,700	2,199,900	2,209,300	2,234,600	2,221,100
準備預金残	2,016,400	2,028,200	2,000,000	2,006,300	2,036,400	2,025,200
レート	0.076%	0.076%	0.075%	0.076%	0.077%	0.075%
月中平均	0.07200%	0.07333%	0.07350%	0.07373%	0.07400%	0.07408%

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