

<<資金需給>>

単位 億円

	14日需給速報		17日需給予想	18日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	900	0
財政		72,100	▲ 32,400	1,000
資金過不足		71,200	▲ 31,500	1,000
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				15,000
国庫短期証売却				
国債買入		4,700		12,000
CP等買入				
		▲ 300	▲ 100	
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				1,300
ETF買入		200	200	
国債補完供給		100		
小計		4,700	0	28,300
当預増減		75,900	▲ 31,500	29,300

当座預金残高	2,297,000	8/14以降の残り所要積立額	100
準備預金残高	2,093,800	8/17以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,755,500	積数	737,600
超過準備	1,755,500	1日平均	24,600
非準備先残高	203,200	積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	2,028,500
準備預金進捗率	63.64%	(実績)	3.23%
		(日数)	

8/13のマネタリーベース		3,176,800	
8/13コール	合計	207,985	無担 77,521 有担 130,464
コール前日増減	計	▲ 84	無担 118 有担 ▲ 202

8/14の加重平均レート(速報)				8/13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
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)		O/N	0.055 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)	
0.073 ~0.120 (0.084)				T/N		0.075 ~0.120 (0.083)		
				S/N				
0.064 ~0.117 (0.104)				1W		0.117 ~0.130 (0.121)		
0.118 ~0.310 (0.120)				2W		0.110 ~0.118 (0.116)		
				3W				
		0.08-0.13	-	1M		0.140 ~0.143 (0.142)		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		0.630 (0.630)		
		0.08-0.12	▲0.003-▲0.001	3M				
		-	-	6M				
		-	-	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

国短買入	15,000億円	8/18	応札	41,473億円	落札	15,001億円	按分利回り較差	0.006%	4.5%	平均利回り較差	0.012%
国債買入	3,750億円	8/18	応札	18,220億円	落札	3,753億円	按分利回り較差	0.003%	52.9%	平均利回り較差	0.004%
国債買入	4,250億円	8/18	応札	12,864億円	落札	4,254億円	按分利回り較差	0.001%	56.5%	平均利回り較差	0.002%
国債買入	4,000億円	8/18	応札	14,728億円	落札	4,002億円	按分利回り較差	0.002%	34.1%	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

8/17の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,265,500	前日比	▲ 31,500
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。

<< 14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5兆9000億円増加の175兆8,000億円(当座預金残高見込みは229兆6,000億円)。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%となった。積み最終日かつ週末を挟んだ取引となったが、昨日とほぼ同水準の立ち上がりであった。一巡後は0.07~0.075%近辺の出合いが中心であった。ターム物は、大手行から1~2Wの期間で調達が見られた。

<< 14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。短国市場は3M物で▲0.003~▲0.001%の出合いが見られた程度で閑散。短国買入オペが前回より2,500億円減額の15,000億円で実施された。落札結果は、平均落札利回較差+0.012% 按分利回較差+0.006%となり、引け値が低い銘柄を中心に応札されたと思われる結果となった。CP市場は、多くの参加者が夏季休業となり、発行総額は400億円にとどまった。発行レートは横ばい圏での動きとなった。

<< 17日の材料 >>

*4-6月期のGDP1次速報(市場予想:前期比年率▲1.9%)

<<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	0.07432%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.07495%	有担	0.03100%

JGB新発10年債	0.375	0.000	日経平均株価(終値)	20,519.45	▲ 76.10	為替(9時)	124.38-40
						為替(5時)	124.33-35

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	8/7	8/10	8/11	8/12	8/13	8/14
日銀当預残	2,229,700	2,199,900	2,209,300	2,234,600	2,221,100	2,297,000
準備預金残	2,028,200	2,000,000	2,006,300	2,036,400	2,025,200	2,093,800
レート	0.076%	0.075%	0.076%	0.077%	0.075%	0.076%
月中平均	0.07333%	0.07350%	0.07373%	0.07400%	0.07408%	0.07444%