

**<<資金需給>>**

単位 億円

	18日需給速報		19日需給予想		20日当社予想	
	即日	金額	金額	金額	金額	金額
銀行券		700	200	▲1,000		
財政		4,400	3,100	▲29,000		
資金過不足		5,100	3,300	▲30,000		
貸出						
売出手形		0				
本店共通		0				
全店共通		0				
共通(固定)		66,339				
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		12,100				
CP等買入		▲100	▲200			
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		100				
国債補充供給						
小計		28,400	▲200	0		
当増減		33,500	3,100	▲30,000		

当座預金残高	2,297,900	8/18以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,093,500		265,300
積み終了先	1,672,700	8/19以降の残り所要積立額	
超過準備	1,638,300	積数	158,400
非準備先残高	204,400	1日平均	5,700
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	92.19% (実績)	9.68%	(日数)

8/17のマナターベース		3,220,200	
8/17コール合計	212,856	無担	79,439
コール前日増減	計 6,499	無担	3,768
		有担	2,731

8/18の加重平均レート(速報)			8/17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
0.030 ~0.125 (0.083)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.074 ~0.120 (0.084)				T/N	0.073 ~0.120 (0.084)	
				S/N		
0.125 (0.125)				1W 0.121 (0.121)	0.130 ~0.340 (0.165)	
0.170 (0.170)				2W 0.118 (0.118)	0.340 (0.340)	
				3W		
		0.08-0.13	-	1M		有担先日付分
		0.08-0.12	-	2M		
		0.08-0.12	▲0.001	3M		
		-		6M		
		-	▲0.07-▲0.025	1Y		

**<<オペ情報、入札結果>>**

CP買入 3,500億円 8/21 応札 7,835億円 落札 3,475億円 按分レート 0.085% 70.5% 平均落札レート 0.089%

米ドル資金供給(固定金利方式) 8/20~8/27 (7日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.640%

T-Bill1Y 応札1兆6,368億円 落札2兆2,876億9,000万円(非競争入札:2,123億円) 8/20~2016/8/22 ▲0.0247% 按分55.9296% 平均▲0.0257%

20年利付国債(表面利率1.3%) 応札3兆2,636億円 落札1兆913億円(I非競争入札:1,076億円) 8/20~2035/6/20 1.148% 按分66.3469% 平均1.144%

「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

<< 8/19の日銀調節とレート予想 >>					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,301,000	前日比	3,100
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.07%台半ばでの出合いが中心になると予想される。					

<< 18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、174兆8,000億円(当座預金残高見込みは、229兆8,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.073~0.076%、大手行からは0.074~0.075%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.075~0.076%と昨日とほぼ同水準の立ち上がりとなった。また複数の業態が試し取りを行った為、加重平均レートが上昇した。一巡後は0.07%近辺で小額の出合いが散見される程度で、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<< 18日のオープン市場動向 >>  
 現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、1Y物の入札が実施された。平均落札利回▲0.0257%、按分落札利回▲0.0247%と、強い結果となった。セカンダリーでは、▲0.07~▲0.025%の出合いが見られた。その他、3Mで▲0.001%の出合いが見られた。CP市場は、5・10日発行にあたり、鉄鋼・ノンバンク業態等から大型発行案件が実施された。3,900億円程度の償還に対し、発行総額は3,500億円程度となった。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。CP等買入れオペが3,500億円で実施され、結果は平均レート0.089%、按分レート0.085%となり、前回(平均0.087%、按分0.085%)比で平均レートが若干上昇した。

<< 19日の材料 >>  
 \*6月の景気動向指数改訂状況  
 \*7月の貿易統計  
 \*米国7月の消費者物価指数  
 \*交付税特別会計借入(10,500億円、8/27借入)

<<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	日経平均株価(終値)	為替(9時)	124.42-44
0.370 ▲0.020	20,554.47 ▲65.79	為替(5時)	124.24-25

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	8/11	8/12	8/13	8/14	8/17	8/18
日銀当預残	2,209,300	2,234,600	2,221,100	2,297,000	2,264,400	2,297,900
準備預金残	2,006,300	2,036,400	2,025,200	2,093,800	2,062,600	2,093,500
レート	0.076%	0.077%	0.075%	0.076%	0.077%	0.083%
月中平均	0.07373%	0.07400%	0.07408%	0.07444%	0.07459%	0.07506%