

**<<資金需給>>**

単位 億円

	19日需給速報		20日需給予想	21日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		100	▲ 800	▲ 2,000
財政		3,400	▲ 29,200	3,000
資金過不足		3,500	▲ 30,000	1,000
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				
国庫短期証売却				
国債買入				7,800
CP等買入				3,500
		▲ 200	▲ 900	
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			200	
国債補充供給				
小計		▲ 200	▲ 700	11,300
当増減		3,300	▲ 30,700	12,300

当座預金残高	2,301,200	8/19以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,093,500		158,400
積み終了先	1,710,000	8/20以降の残り所要積立額	
超過準備	1,688,300	積数	101,400
非準備先残高	207,700	1日平均	3,800
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	95.00%	(実績)	12.90% (日数)

8/18のマナターベース		3,253,000	
8/18コール合計	213,668	無担	81,875
コール前日増減	計	812	無担
		2,436	有担
			▲ 1,624

8/19の加重平均レート(速報)			8/18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
0.060 ~0.125 (0.077)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.030 ~0.125 (0.083)	
0.074 ~0.120 (0.082)				T/N	0.074 ~0.120 (0.084)
				S/N	
0.070 ~0.130 (0.107)				1W	0.125 (0.125)
				2W	0.170 (0.170)
				3W	
		0.08-0.13	-	1M	
		0.08-0.12	-	2M	
		0.08-0.12	▲0.005-▲0.002	3M	
		-	-	6M	
		-	▲0.07-▲0.06	1Y	

**<<オペ情報、入札結果>>**

国債買入	4,000億円	8/21	応札	11,068億円	落札	4,007億円	按分利回り較差	-0.004%	15.0%	平均利回り較差	-0.002%
国債買入	2,400億円	8/21	応札	4,723億円	落札	2,400億円	按分利回り較差	-0.018%	30.0%	平均利回り較差	-0.009%
国債買入	1,400億円	8/21	応札	5,167億円	落札	1,402億円	按分利回り較差	-0.022%	21.6%	平均利回り較差	-0.016%
交付税特会	1兆500億円	8/27~2016/2/29	応札	3兆1,152億円	落札	1兆500億円	0.078%	按分11.8765%	平均0.078%		
ETF買入	337億円	約定日	8/19								

「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

8/20の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,270,500	前日比	▲ 30,700
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。

**<< 19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、174兆6,000億円(当座預金残高見込みは、230兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.074~0.077%、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0.075~0.077%と昨日とほぼ同水準の立ち上がりとなった。また、一部業態より0.125%で少額の試し取りが行われた。一巡後は0.07%近辺を中心とした少額の出合いで推移し、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、出合いは閑散であった。

**<< 19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、3Mで▲0.005~▲0.002%、1Yで▲0.07~▲0.06%の出合いが見られた。材料に乏しく、閑散とした地合いながらも堅調に推移した。CP市場は、ノンバンク業態からの大型発行案件が実施され、1,200億円程度の償還に対し、1,300億円程度の発行が見られた。発行レートは横ばい圏での推移となった。

**<< 20日の材料 >>**  
\*米国7月の中古住宅販売  
\*国庫短期証券入札(3ヶ月、51,000億円、8/24発行)  
\*流動性供給入札(5,000億円、8/24発行)

◀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)	124.38-40
0.370	0.000	20,222.63	▲ 331.84
		為替(5時)	124.25-26

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	8/12	8/13	8/14	8/17	8/18	8/19
日銀当預残	2,234,600	2,221,100	2,297,000	2,264,400	2,297,900	2,301,200
準備預金残	2,036,400	2,025,200	2,093,800	2,062,600	2,093,500	2,093,500
レート	0.077%	0.075%	0.076%	0.077%	0.083%	0.077%
月中平均	0.07400%	0.07408%	0.07444%	0.07459%	0.07506%	0.07516%

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