

《資金需給》

単位 億円

	24日需給速報		25日需給予想	26日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 300	▲ 100	0
財政		▲ 9,700	7,600	1,000
資金過不足		▲ 10,000	7,500	1,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		2,700		
66,190		▲ 2,800		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入			17,500	
国庫短期証売却				
国債買入			12,200	
CP等買入				
		▲ 300	▲ 600	
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		
国債補完供給		300		
小計		0	29,100	0
当預増減		▲ 10,000	36,600	1,000

当座預金残高	2,272,900	8/24以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,071,400		27,500
積み終了先	1,719,900	8/25以降の残り所要積立額	
超過準備	1,716,800	積数	20,100
非準備先残高	201,500	1日平均	900
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	99.01% (実績)	29.03% (日数)	

8/21のマナターベース				3,240,200		
8/21コール	合計	206,288	無担	77,367	有担	128,921
コール前日増減	計	▲ 22	無担	261	有担	▲ 283

8/24の加重平均レート(速報)				8/21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		有担当日分
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)				0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.073 ~0.120 (0.081)						T/N	0.071 ~0.120 (0.082)	
						S/N		
0.117 ~0.150 (0.126)						1W	0.071 ~0.123 (0.111)	
0.130 ~0.310 (0.160)						2W		
0.135 (0.135)						3W		
0.170 (0.170)				0.08-0.13	-	1M	0.170 (0.170)	0.165 ~0.200 (0.183)
				0.08-0.12	-	2M		
				0.08-0.12	-	3M		
				-	-	6M		
				-	-	1Y		

《オペ情報、入札結果》

被災地支援(第52回) 8/28~2016/8/26 (364日間) 貸付予定総額 431億円 貸付利率 0.10%

ETF買入 337億円 約定日 8/24

J-REIT買入 13億円 約定日 8/24

「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。」

8/25の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,309,500	前日比	36,600
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。

《 24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、172兆1,000億円(当座預金残高見込みは、227兆3,000億円)。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%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.076~0.077%となった。一巡後は、0.07~0.075%での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ロール案件での出合いが散見される程度であった。

《 24日のオープン市場動向 》
 現先S/Nは横ばい圏で推移した。短国市場は、特段の材料も無く、出合いは見られなかった。CP市場は、石油業態からまとまった発行が実施されたものの、総額は1,200億円程度にとどまった。発行レートは、全体的に横ばい圏でありながらも、低下余地を探る銘柄が散見された。

- 《 25日の材料 》
- *6月のS & P/ケース・シラー住宅価格指数
 - *米国7月の新築一戸建て販売件数
 - *米国8月のC B消費者信頼感指数
 - *40年利付国債入札(4,000億円、8/27発行)
 - *交付税特別会計借入(10,500億円、9/2借入)

JGB新発10年債	0.345	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	18,540.68	▲ 895.15	為替(9時)	121.72-75
						為替(5時)	120.40-41

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	8/17	8/18	8/19	8/20	8/21	8/24
日銀当預残	2,264,400	2,297,900	2,301,200	2,271,000	2,282,900	2,272,900
準備預金残	2,062,600	2,093,500	2,093,500	2,061,400	2,076,900	2,071,400
レート	0.077%	0.083%	0.077%	0.076%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07459%	0.07506%	0.07516%	0.07520%	0.07543%	0.07546%

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