

<<資金需給>>

単位 億円

	25日需給速報		26日需給予想	27日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 200	▲ 600	▲ 1,000
財政		7,600	1,200	▲ 4,000
資金過不足		7,400	600	▲ 5,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				
66,190				
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		▲ 600	▲ 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				
ETF買入			300	
国債補完供給				
小計		29,100	100	0
当預増減		36,500	700	▲ 5,000

当座預金残高	2,309,400	8/25以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,102,100		20,100
積み終了先	1,749,500	8/26以降の残り所要積立額	
超過準備	1,749,400	積数	15,600
非準備先残高	207,300	1日平均	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	99.23% (実績)	32.26% (日数)	

8/24のマナターベース				3,230,500		
8/24コール	合計	213,302	無担	78,952	有担	134,350
コール前日増減	計	7,014	無担	1,585	有担	5,429

8/25の加重平均レート(速報)				8/24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)			O/N	0.060 ~0.125 (0.076)	0.030	~0.040 (0.031)
0.073 ~0.125 (0.092)						T/N		0.073	~0.120 (0.081)
						S/N			
0.130 ~0.165 (0.145)						1W	0.117	(0.117)	0.130 ~0.150 (0.138)
0.116 ~0.170 (0.142)						2W			0.130 ~0.310 (0.160)
						3W			0.135 (0.135)
				0.08-0.13	-	1M		0.170	(0.170)
				0.08-0.12	-	2M			
				0.08-0.12	-	3M			
				-	-	6M			
				-	-	1Y			

<<オペ情報、入札結果>>

米ドル資金供給(固定金利方式) 8/27~9/3 (7日間) 応札 200万ドル 落札 200万ドル 貸付利率 0.640%
 40年利付国債(表面利率1.4%) 応札9,183億円 落札3,998兆億円 8/27~2055/3/20 1.535% 按分82.2695%
 交付税特会 1兆500億円 9/2~2016/3/2 応札3兆3,210億円 落札1兆500億600万円 0.076% 按分39.1000% 平均0.075%

「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

8/26の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,310,100	前日比	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。

<< 25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、175兆9,000億円(当座預金残高見込みは、231兆円)。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、調達レートが低下し、0.073~0.075%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、大手行が2W物0.118%で調達を行った。

<< 25日のオープン市場動向 >>
 現先レートS/Nは同水準で推移した。短国市場は、非常に落ち着いた状態が続いており、昨日に引き続き出合いは見られなかった。CP市場は、小額の発行が中心で、発行総額は200億円程度。発行レートに特段の変化はなく、横ばい圏での出合い。

<< 26日の材料 >>

- *月例経済報告
- *7月の企業向けサービス価格指数
- *米国7月の耐久財新規受注

JGB新発10年債	0.370	0.025	日経平均株価(終値)	17,806.70	▲ 733.98	為替(9時)	118.89-90
						為替(5時)	119.72-75

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	8/18	8/19	8/20	8/21	8/24	8/25
日銀当預残	2,297,900	2,301,200	2,271,000	2,282,900	2,272,900	2,309,400
準備預金残	2,093,500	2,093,500	2,061,400	2,076,900	2,071,400	2,102,100
レート	0.083%	0.077%	0.076%	0.077%	0.076%	0.076%
月中平均	0.07506%	0.07516%	0.07520%	0.07543%	0.07546%	0.07548%