

<<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		1,200		600		0
財政		▲ 39,600		▲ 700		▲ 16,000
資金過不足		▲ 38,400		▲ 100		▲ 16,000
貸出				▲ 100		
売出手形						
0						
本店共通						
0						
全店共通						
0						
共通(固定)		4,800				
105,069		▲ 3,900				
国債買現						
0						
CP買現						
0						
国庫短期証買入				20,000		
国庫短期証売却						
国債買入				9,200		
CP等買入						
		▲ 100		▲ 300		
貸出支援基金 (成長) 34,837 (増加) 133,488						
被災地支援						
3,623						
社債等買入						
ETF買入		100				
国債補完供給						
小計		900		28,800		0
当預増減		▲ 37,500		28,700		▲ 16,000

当座預金残高	1,498,600	8/18以降の残り所要積立額	402,800
準備預金残高	1,363,600	8/19以降の残り所要積立額	
積み終了先	1,084,800	積数	285,300
超過準備	1,021,100	1日平均	10,200
非準備先残高	135,000	積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	1,901,100
準備預金進捗率	84.99% (実績)		9.68% (日数)

8/15のマネタリーベース		2,446,800	
8/15コール	合計	171,297	無担 75,938 有担 95,359
コール前日増減	計	▲ 4,357	無担 ▲ 4,703 有担 346

8/18の加重平均レート(速報)				8/15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	有担先日付分	
0.045 ~0.135 (0.066)	0.030 ~0.040 (0.031)			O/N 0.040 ~0.135 (0.068)			0.030 ~0.040 (0.031)	
0.061 ~0.125 (0.085)				T/N	0.061 ~0.125 (0.080)			
				S/N				
0.117 ~0.400 (0.151)				1W	0.116 ~0.200 (0.149)			
0.118 (0.118)				2W	0.118 (0.118)			
				3W				
0.118 (0.118)		0.08-0.12	-	1M	0.116 ~0.118 (0.117)		有担先日付分	
		0.08-0.12	-	2M				
		0.08-0.12	0.022-0.024	3M				
		-	-	6M				
		-	0.015-0.018	1Y				

<<オペ情報、入札結果>>

CP買入 4,500億円 8/21 応札 10,349億円 落札 4,431億円 按分レート 0.092% 52.7% 平均落札レート 0.094%
 T-Bill1Y 応札12兆8,585億円 落札2兆3,195億5,000万円(非競争入札:1,804億円) 8/20~2015/8/20 0.0200% 按分80.9033% 平均0.0180%

<<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	0.06761%	有担	0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06727%	有担	0.03100%

<< 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	1,527,300	前日比	28,700
O/N	0.06~0.07	T/N	0.06~0.12	S/N	0.06~0.12

無担O/Nは0.06~0.065%程度での出合いが中心になると見込まれる。

<< 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、前日比4兆6,000億円減少の113兆9,000億円(当座預金残高見込みは149兆9,000億円)。無担O/Nの立ち上がりは大手行から0.06%前後、信託業態から0.06%台半ばの調達で始まった。新しい積み期に入ったものの、週末の年金定時払いによって積みの進捗は大幅に進んでいることもあって、地銀業態からの調達は弱めであった。一部業態より0.065%を超える出合いもみられたものの、一巡後は0.061%を中心とした出合いで推移し、本日の取引を終了した。T/Nは0.061%の調達が散見された。

<< 18日のオープン市場動向 >>

現先レートS/Nは、先週末と同水準で推移した。短国市場は、新発1Y物の入札が実施された。按分落札利回り0.0200%、平均落札利回り0.0180%、按分率80.9033%と概ね予想通りの結果となった。アウトライトは、3M:0.022~0.024%、1Y:0.015~0.018%と堅調な出合いが見られた。CP市場は、CP等買入オペが実施された。按分レート0.092%、平均落札レート0.094%、按分率52.7%とほぼ前回並みの結果となった。プライマリー市場は、鉄鋼・住宅・小売業態から幅広く調達が行われ、発行総額は1,800億円程度となった。発行レートは、横ばい圏であった。

<< 19日の材料 >>

- *6月の景気動向指数改訂状況
- *米国7月の消費者物価指数 *米国7月の住宅着工件数
- *英国7月の消費者物価指数
- *20年利付国債入札(12,000億円、8/21発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、8/27借入)

JGB新発10年債	0.495	▲ 0.005	日経平均株価(終値)	15,322.60	4.26	為替(9時)	102.41-42
						為替(5時)	102.47-48

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	8/15	8/18
日銀当預残	1,471,400	1,473,800	1,500,100	1,494,600	1,536,100	1,498,600
準備預金残	1,350,000	1,349,400	1,370,400	1,369,400	1,399,800	1,363,600
レート	0.066%	0.067%	0.067%	0.068%	0.068%	0.066%
月中平均	0.06836%	0.06825%	0.06815%	0.06814%	0.06812%	0.06800%

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

「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。」